博时大中华亚太精选股票证券投资基金

2010 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：2011年3月31日

§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。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年3月30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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年7月27日起至12月31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	96,477,439.65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%。 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。
业绩比较基准	65%×MSCI Zhonghua+35%×MSCI AC Asia Pacific ex Zhonghua
风险收益特征	本基金属于高风险/高收益的品种。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	赵会军
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798

2.4境外投资顾问和境外资产托管人

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

2.5信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年7月27日(基金合同生效日)至2010年12月31日
本期已实现收益	1,694,029.99
本期利润	4,095,799.97
加权平均基金份额本期利润	0.0243
本期基金份额净值增长率	3.10%
3.1.2 期末数据和指标	**2010年末**
期末可供分配基金份额利润	0.0250
期末基金资产净值	99,497,156.22
期末基金份额净值	1.031

注：本基金合同于2010年7月27日生效，基金合同生效日起至报告期末不满一年。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

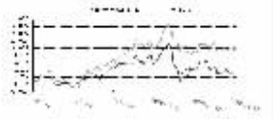
3.2基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.27%	1.05%	3.27%	0.92%	-5.54%	0.13%
自基金合同生效起至今	3.10%	0.85%	10.19%	0.86%	-7.09%	-0.01%

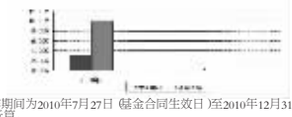
注：本基金的业绩比较基准为：65%×MSCI Zhonghua+35%×MSCI AC Asia Pacific ex Zhonghua。

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。截至报告期末本基金建仓期尚未结束。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金2010年实际运作期间为2010年7月27日（基金合同生效日）至2010年12月31日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

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

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。为国民创造财富"是博时的使命。博时的投资理念是"做投资价值的发现者"。截至2010年12月31日，博时基金公司共管理二十只开放式基金和三只封闭式基金，并且受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，特定资产管理账户，资产管理总规模逾1874亿元，累计分红超过人民币532亿元。博时基金管理有限公司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、客户服务

1）为提供安全、高效的网上交易环境，博时公司不断升级网上交易系统的安全功能；2010年1月，博时快e通系统增加了动态验证码的功能，对客户身份进行验证；2010年3月，博时快e通直销交易系统在所有密码输入区域都设置了密码安全控件，大大提高了交易安全性。

2）2010年4月，博时基金客服中心推出了新版的在线客服系统，新系统能够支持更多新功能，例如，客户和坐席均能查到前面等待的客户数量，客户除了在线等待以外，还可以选择留言功能，留下自己的问题和联系方式，客服代表会及时给予回复。同时在线坐席可以根据等待客户的情况，合理控制在线交流节奏。

3）"博时e视界"于9月18日正式发布，这也是博时基金顶力为投资人打造的与投资专家面对面的全新视听网络平台。

4）2010年10月，博时基金与中国劳动保障报社联合举办"企业年金管理大家谈"有奖征文活动。向较早建立企业年金计划的企业征集管理经验与其他企业分享。

5）2010年，博时在全国各地举办各类客户活动、论坛、沙龙等共计1252场，并创新的采用网络会议室，扩大论坛的覆盖面，充分与投资者沟通当前市场的热点问题，受到了广泛大投资者的广泛欢迎。

2、社会责任

1）为支援玛曲灾区的救灾善后工作，博时基金公司及全体员工通过博时慈善基金会向甘肃省红十字会捐出赈灾款项人民币30万元。

2）博时慈善基金会2010年关爱助学现场捐赠仪式于2010年12月6日在中山大学举办，博时以每人5000元的标准向中山大学的21位贫困学生资助善款105000元，至此博时基金第四届百万关爱助学活动圆满落幕。

3、公司荣誉

1）博时在由证券时报社主办的2009年度中国明星基金奖评选中，荣获两个奖项，博时主题行业基金获得"2009年度三年持续回报股票型明星基金奖"，博时平衡配置获得"2009年度三年持续回报平衡混合型明星基金奖"。

2）博时在由中国证券报社主办的第七届中国基金业金牛奖评选中连续第三次荣获中国基金业最具权威的"金牛基金公司奖"，并获得首次设立的"金牛特别贡献奖"，旗下基金博时裕隆封闭、博时主题行业股票、博时平衡配置混合和博时现金收益货币均蝉联金牛奖项，分别获得"三年期封闭式持续优胜金牛基金"、"三年期开放式股票型持续优胜金牛基金"、"三年期开放式混合型持续优胜金牛基金"和"2009年度开放式货币市场金牛基金"奖项。

3）2010年8月14日博时基金网站在由证券时报主办的"第十一届中国优秀财经证券网站"评选中荣获"最佳基金网站奖"。

4、其他大事件

1）博时创业成长股票型证券投资基金首募顺利结束并于2010年6月1日成立，首次募集资金超过34亿元。

2）博时大中华亚太精选股票证券投资基金及博时宏观回报债券型证券投资基金首募顺利结束并于2010年7月27日成立。

3）博时转债增强债券型证券投资基金及博时行业轮动股票型证券投资基金首次募集顺利结束并分别于2010年11月24日和2010年12月10日成立。

4）根据中国证券监督管理委员会的批复，博时基金已在香港完成博时基金（国际）有限公司（Bosera Asset Management（International）Co.，Limited）的注册登记手续并获香港证券及期货事务监察委员会颁发的第4类（就证券提供意见）和第9类（提供资产管理）牌照；

5）博时基金于2010年8月25日和2010年11月11日分别公告郑州分公司和沈阳分公司成立。至此，博时基金已有4家分公司分别落地北京、上海、郑州和沈阳。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨锐	基金经理/首席策略分析师/副总裁/混合组投资总监	2010-7-27	-	11.5	1999年加入博时公司，任研究员；2004任研究部副总经理、高级策略分析师；2005组约大学进修；2006.5兼任平衡配置基金经理；2007.1起兼任价值增长、价值增长贰号基金经理。现任公司副总裁、首席策略分析师、混合组投资总监、博时平衡配置混合基金、博时大中华亚太精选股票基金基金经理。
王政	基金经理/ETF及量化投资组投资总监	2010-7-27	-	12	1995年至1997年在哈佛大学从事地球物理博士后研究工作。1997年8月起先后在美国新泽西州道琼斯投资公司、美国新泽西州影博资讯研发部、美国加州巴克莱全球投资公司工作。2009年5月加入博时基金管理有限公司。现任ETF及量化投资组投资总监兼博时上证超大盘ETF及联接基金基金经理、博时大中华亚太精选股票基金基金经理。

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	职务	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
詹嘉琳	富敦公司投资总监	22		1986年-1996年在新加坡金融管理局任高级助理署长；1996年-2000年在荷兰银行任亚洲日本外策略与经济部主管；2000年在淡马锡控股有限公司任资金管理组股票投资部主管；2002年5月至今富敦资金管理有限公司投资总监。
张儒华	富敦公司股票部主管/富敦公司股票投资组基金经理	19		1988年4月-1992年5月在星展银行任助理资金专员；1992年5月在淡马锡控股有限公司任资金管理部门股票投资组主管，2003年12月至今在富敦资金管理有限公司股票投资组主管。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《博时大中华亚太精选股票证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定，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，在严格控制风险的基础上，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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年，国际金融市场风云变幻。上半年，欧洲债务危机爆发，导致全球股市大幅震荡；中国出台严厉地产调控政策，港股市场雪上加霜。直到9月份，随着避险情绪降温，市场慢慢关注第二轮量化宽松，全球股市方有起色。

本基金自2010年7月27日成立，由于当时市况的不明朗，我们一开始比较谨慎，净值始终保持在1附近。直到9月初，我们留意到市场上出现了一些积极的信号，于是开始大规模建仓。回过头来看，我们的时点判断比较准，通过在港股的黄金、航空、建材、工程机械、电力设备等行业的配置，以及对台湾的科技股、韩国的工业股、澳洲的矿业股的配置，获得了一定收益。

然而11月份，市场开始预期中国加息，以致中资股大跌；爱尔兰又爆发债务危机，影响了投资者情绪。港股在这期间波动较大，我们的基金净值有了一定的回调。对于市场环境和情绪的变化，我们作出了积极的应对。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日，本基金份额净值为1.031元，累计净值为1.031 元。报告期内，本基金份额净值增长率为3.10%，同期业绩基准增长率为10.19%。

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2011年，我们最关注的两大主题是"货币"和"转型"，也就是后危机时代全球货币泛滥带来的资产价格上涨，以及中国的经济结构从出口导向型逐步转变到内需拉动型的过程中带来的一些投资机会。

放眼国际市场，美国经济出现了一些令慢慢复苏的迹象，2011年美国的GDP增长率可能逐季走高，这对美股有利；而另一方面，欧洲的高负债、高赤字、高失业率问题会继续困扰以后付即将到期的债务，评级机构可能继续下调欧洲银行的评级，欧洲主权债务危机将在2011年继续困扰市场。美国为了保住得来不易的复苏成果，预计将会在较长一段时间内维持量化宽松的政策。欧洲酒国要解决问题欧性爆发的债务危机，唯一的可行办法就是多发货币。因而可以预见，欧美经济体的货币超发现象在短期内不会结束，大量货币必然寻找出路，带来各类资产价格的继续上涨。

欧美货币泛滥，向亚洲国家输出了通胀。持续的通货膨胀压力将促使亚洲各国进一步加息，也造成亚洲各国货币升值的压力大增。在亚洲各国货币的升值趋势下，各国如何进行经济结构转型，能否在全球经济由不平衡到再平衡的过程中确立各国的产业优势，是我们需要密切关注的投资主题。我们将一如既往地贯彻本基金成立的初衷，即寻找最受惠于中国巨大内需以及亚太地区产业优势的投资标的来进行投资。

目前MSCI亚太指数、MSCI中华指数的估值分别为12倍、11倍2011年市盈率，仍属合理水平。股息收益率为3%左右，高于短期存款利率，因此亚太地区的股票估值仍然具有吸引力。然而，经过危机之后的2009、2010年两年的估值修复，市场上许多股票（如大多数消费股和医药股）已经变得不便宜，因此我们对前期上涨过多的股票将相对谨慎，而对被很多人遗忘很久但基本面其实不错的股票将更加关注，如金融、电信等。同时，我们认为在科技、工业、金属、建材等热门行业仍然会有机会出现，值得我们继续投资。

总之，2011年将是多重利空频繁的力量最强烈较劲的一年，市场但可能将在震荡中前行，难以出现明显的单边市。行业的差异化会很明显，同一个行业内的个股也会有较大差异，这要求基金经理有很强的选股能力。我们会积极在震荡中寻找价值洼地，争取为基金持有人带来超额收益。

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、研究总监、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表决。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，当存在异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期末本基金份额可分配收益为0.0250元。

本基金管理人已于2011年1月12日发布公告，以2010年12月31日实现的可分配利润为基准，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

2010年，本基金托管人在对博时大中华亚太精选股票型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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年，博时大中华亚太精选股票型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股票型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股票型证券投资基金2010年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 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1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：2010年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010年12月31日
资 产：	
银行存款	36,576,914.90
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	74,318,228.20
其中：股票投资	74,318,228.20
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	1,033.41
应收股利	22,124.18
应收申购款	88,430.23
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	111,006,730.92
负债和所有者权益	**本期末 2010年12月31日**
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	10,837,695.56
应付赎回款	432,635.67
应付管理人报酬	148,699.22
应付托管费	28,913.76
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	-
递延所得税负债	-
其他负债	61,630.49
负债合计	11,509,574.70
所有者权益：	
实收基金	96,477,439.65
未分配利润	3,019,716.57
所有者权益合计	99,497,156.22
负债和所有者权益总计	111,006,730.92

注：1. 报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.031元，基金份额总额96,477,439.65份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2010年7月27日（基金合同生效日）至2010年12月31日。

7.2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：2010年7月27日（基金合同生效日）至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年7月27日(基金合同生效日)至2010年12月31日
一、收入	6,893,828.38
1.利息收入	504,283.68
其中：存款利息收入	238,903.97
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	265,379.71
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	4,365,072.22
其中：股票投资收益	3,948,745.12
基金投资收益	-
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	416,327.10
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,401,769.98
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-998,693.35
5.其他收入(损失以"-"号填列)	621,395.85
减：二、费用	2,798,028.41
1.管理人报酬	1,266,978.07
2.托管费	246,356.86
3.销售服务费	-
4.交易费用	1,129,127.22
5.利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	155,566.26
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	4,095,799.97
减：所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	4,095,799.97

7.3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：2010年7月27日（基金合同生效日）至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年7月27日(基金合同生效日)至2010年12月31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)	554,725,884.96	-	554,725,884.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,095,799.97	4,095,799.97
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)	-458,248,445.31	-1,076,083.40	-459,324,528.71
其中：1.基金申购款	36,021,956.09	1,769,131.95	37,791,088.04
2.基金赎回款	-494,270,401.40	-2,845,215.35	-497,115,616.75
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)	96,477,439.65	3,019,716.57	99,497,156.22

本报告7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：肖风，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：成江

7.4报表附注

7.4.1重要会计政策和会计估计

7.4.11会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2010年7月27日（基金合同生效日）至2010年12月31日。

7.4.1.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.1.3金融资产和金融负债的分类

①金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

②金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.1.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于交付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.1.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

①存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

②存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

③当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.1.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.1.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.1.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末金额转入分配利润/（累计亏损）。

7.4.1.9收入/损失的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利和除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.1.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.1.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未实现利润中的未实现部分（包括基金投资活动产生的未实现利润以及基金份额交易产生的未实现平准金）为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分与期末未实现利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分抵扣未实现部分后的余额）。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.1.12外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.1.13分派报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：①该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；②本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；③本基金能够取得该组成部分的财务状况，经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.1.14其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.2会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1会计政策变更的说明

无。

7.4.2.2会计估计变更的说明

无。

7.4.2.3差错更正的说明

无。

7.4.3关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（"博时基金"）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（"中国工商银行"）	基金托管人、基金代销机构
渣打银行(香港)有限公司（"渣打银行"）	境外资产托管人
招商证券股份有限公司（"招商证券"）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
璟安实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业资产管理有限公司	基金管理人的股东
丰益实业发展有限公司	基金管理人的股东
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。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年7月27日(基金合同生效日)至2010年12月31日止期间	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商香港	49,171,964.56	8.87%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年7月27日(基金合同生效日)至2010年12月31日止期间			
	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	49,171.96	8.55%	-	-

7.4.4.2关联方报酬

7.4.4.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年7月27日(基金合同生效日)至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,266,978.07
其中：支付销售机构的客户维护费	86,506.34

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。

7.4.4.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年7月27日(基金合同生效日)至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	246,356.86

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。

7.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期 2010年7月27日(基金合同生效日)至2010年12月31日
基金合同生效日（2010年7月27日）持有的基金份额	30,002,000.00
期初持有的基金份额	-
期间申购总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回总份额	-
期末持有的基金份额	30,002,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.10%

注：本基金的基金管理人博时基金在本年度认购本基金的交易委托招商证券办理，适用费率为1.0007元/笔。

7.4.4.4.2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。

7.4.4.5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 2010年7月27日(基金合同生效日)至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,