博时大中华亚太精选股票证券投资基金

2014 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:2015年3月28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3月27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。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

根据基金管理人2014年12月1日发布的《博时基金管理有限公司关于博时大中华亚太精选股票证券投资基金增加美元现汇基金份额的公告》,自2014年12月3日起增设博时大中华亚太精选股票证券投资基金元现汇基金份额(基金代码为:000927)。具体内容请查阅指定报刊上的各项相关公告。

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。

§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	109,824,383.05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
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		洪小源	姜建清

2.4境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Fullerton Fund Management Company Ltd.	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	富敦资金管理有限公司	渣打银行(香港)有限公司

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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	3,094,651.60	14,676,845.44	2,672,320.45
本期利润	71,582.72	15,939,344.49	16,257,805.27
加权平均基金份额本期利润	0.0006	0.1759	0.1931
本期基金份额净值增长率	3.35%	21.07%	25.59%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0272	0.0776	-0.0972
期末基金资产净值	130,340,642.82	87,846,549.73	86,745,014.23
期末基金份额净值	1.187	1.218	1.006

注:本期已实现收益指本基金本期利息收入、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。

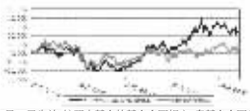
3.2基金净值表现

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	1.80%	1.18%	3.56%	0.85%	-1.76%	0.33%
过去六个月	-3.96%	0.97%	0.34%	0.75%	-4.30%	0.22%
过去一年	3.35%	1.03%	3.68%	0.73%	-0.33%	0.30%
自基金合同生效起至今	26.60%	1.09%	6.33%	1.02%	20.27%	0.07%

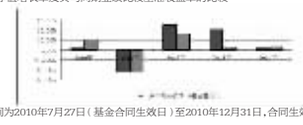
注:本基金的业绩比较基准为:65%×MSCI Zhonghua+35%×MSCI AC Asia Pacific ex Zhonghua

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的基金合同于2010年7月27日生效,按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第11条"二、投资范围"、"六、投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3合同生效日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

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2014年	0.700	3,894,763.85	1,288,622.89	5,183,386.74	分配2013年度红利
2013年	-	-	-	-	-
2012年	-	-	-	-	-
2011年	0.060	415,059.30	156,414.57	571,473.87	分配2010年度红利
合计	0.760	4,309,823.15	1,445,037.46	5,754,860.61	-

§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12月31日,博时基金公司共管理五十三只开放式基金,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。博时基金公司管理净值总规模逾2363亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1124亿元人民币,累计分红超过638亿元人民币,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12月31日,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第6,博时特许价值股票基金年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名第12;博时精选股票基金在7只同类普通股票型基金中排名前1/2;博时裕富沪深300指数基金在同类150只标准指数股票型基金中排名前1/5,博时上证超大盘ETF及博时深证基本面200ETF在150只标准指数股票型基金中均排名前1/2;博时上证超级大盘ETF联接及博时深证基本面200ETF联接在同类45只产品中排名前1/2。混合基金中,博时裕益灵活配置混合在34只灵活配置型基金中排名前1/4,博时价值增长混合及博时价值增长贰号混合在同类29只产品中排名前1/2;博时平衡配置混合在同类16只产品中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债券(A/B类)今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第1;博时信用债券(C类)今年以来收益率在56只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(B类)今年以来收益率在41只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在67只同类普通债券型基金中排名第2;博时转债增强债券(A类)今年以来收益率在13只可转换债券基金中排名第3;博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3,博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A类)及博时月月新定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/2;博时宏观回报债券(A/B类)及博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券型基金中分别排名第7、第8;博时现金收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至12月31日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只ODII债券基金中排名第1,博时抗通胀在8只ODII商品基金中排名第1。

2)客户服务

2014年,博时基金共举办各类渠道培训及活动718场,参加人数18775人。

3)其他大事件

2014年12月18日,博时国际获得和讯海外财经风云榜"2014年度最佳中资基金公司奖";

2014年12月25日,博时基金获资金融界评选的"最佳品牌奖";

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"。

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		
张溪冈	基金经理/国际组投资总监	2011-02-28	-	12.5	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。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Manraj Singh Sekhon	富敦公司总裁兼首席投资官	18	1994年1月-2002年4月在水星资产管理公司(Mercury Asset Management)任全球股票部高级基金经理;2002年5月-2003年3月在景顺资产管理公司(Invesco Asset Management)任全球股票部副主管;2003年11月-2011年9月在罗德森全球投资(Henderson Global Investors)任总监兼国际股票部主管;2011年10月至今富敦资金管理有限公司总裁兼首席投资官。
张儒华	富敦公司股票投资组基金经理	22	1988年4月-1992年5月在星展银行任助理资金专员;1992年5月在波马摇投投资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任资深股票投资经理。

注:根据博时基金管理有限公司管理博时大中华亚太精选股票证券投资基金的实际情况,经过双方协商,本公司决定自2014年12月12日起终止与富敦资金管理有限公司签署的投资顾问协议,自该日起富敦资金管理有限公司不再担任博时大中华亚太精选股票证券投资基金的投资顾问。

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、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 公平交易制度和控制方法

报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求,公司进一步完善了《公平交易管理制度》,通过系统及人工相结合的方式,分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程,按照境内及境外业务进行了详细规范,同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.4.2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《公平交易管理制度》的规定,在研究、决策、交易执行等各环节,通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的现象。

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

2014年,港股有波幅、无升幅,全年恒生指数轻微上涨1.28%。这一表现相对对国A股超过50%的升幅来说,显然是弱了许多。港股和A股之所以出现多年来罕见的巨大差异化表现,一方面是受到香港"占领中环"事件的影响;另一方面是因为香港市场的资金面受到了美国退出量化宽松的负面影响,资金面明显不如受到减息刺激的A股市场那样宽松。

尽管中央政府于2014年11月开通了沪港通,但从市场表现来看,投资者对港股的需求并不旺盛。市场对沪港通开通的炒作,仅仅出现在7.8月两个月时间,到了9月份便因为中环事件而回到原点。11月,中国央行进行了自2012年7月以来的首次降息,这令A股市场在年底出现了疯狂的上涨。但由于中国降息只发松了国内的货币市场,对香港的资金面基本没有作用,因此降息之后,香港市场中只有金融股有一定表现。同时,前两年表现优异的环保、医药、信息技术等行业个股则大幅下跌。

本基金面对2014年复杂的市场形势,尽管仍实现了3%的正收益,与基准基本持平,但我们深知表现并不理想。2014年,出现了很多难以把握的宏观事件,如占领中环、沪港通、降息之后的风格转换等等,这些干扰因素令投资难以提前预判。除此之外,我们也需反思,在信息技术、医药、电力、铁路建设等行业仍然出现了许多基于本国的牛股,我们需要进一步加强研究能力,学习、学习、再学习。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为1.187元,累计份额净值为1.263元,报告期内净值增长率为3.35%,同期业绩基准涨幅为3.68%。

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2015年,香港占中事件对市场的负面影响已逐渐消退,但长期来看可能对香港投资者的信心形成了一定的阴影。缺乏建设性意见的社会纷争、过于依赖金融地产的单一化的经济结构、以及居高不下的楼价,恐怕会损害香港的长期竞争力。香港本地的金融、地产股将受到美国结束量化宽松(尤其是终将到来的加息)的负面影响,香港本地消费股也会因为内地自由行旅客消费增长的放缓而难有表现。

然而,我们对香港的中资股相对乐观。中国已开始降息,并且我们预期2015年仍有降息和降准的空间,这一方面是因为中国经济的保增长需要较为宽松的货币政策支持,另一方面是因为油价大幅下跌,通胀压力已经减弱。2015年,中国的货币环境趋于宽松,尤其是利率下降,政府实施补税的财政政策,这些都有利于中资股的表现。目前A股相对港股存在较高溢价,而沪/港通已经开通,在水往低处流的趋势下,低估值的香港中资股对国内外的投资者都很有吸引力。

2015年,以现未来更长一段时间,我们认为香港本地股将可能会跑输中资股,我们更看好香港中资股未来的表现。我们会积极挖掘受益于大资源品价格下跌的工业、交运等行业个股,同时我们也会持续关注TMT、环保等长期空间较大的行业个股机会。

此外,相对于前两年,2015年我们会更重视自上而下的宏观分析,重点包括:1)美联储加息、退出量化宽松的节奏;2)中国降息、降准的节奏;3)可能的黑天鹅事件,如俄罗斯、希腊、中东等地区的不稳定因素,尤其是国内反腐导致的不确定性。

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议采用。估值委员会成员均具有6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。

本基金管理人已于2014年1月10日发布了分红公告,以截止到2013年12月31日的可供分配利润为基准,向基金份额持有人每10份基金份额派发红利0.70元。

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2,985,824.00元。

本基金管理人已于2014年1月10日发布了分红公告,以截止到2013年12月31日的可分配利润为基准,每10份基金份额派发红利0.06元。

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遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对博时大中华亚太精选股票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

本报告期内,博时大中华亚太精选股票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股票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5,183,386.74元。

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证券投资基金2014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:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	6,696,040.47	10,632,864.25
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	121,223,033.37	79,670,324.00
其中:股票投资	116,531,165.82	76,503,664.41
基金投资	4,691,867.55	3,166,659.59
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	5,309,088.55	-
应收利息	772.72	819.52
应收股利	17,986.24	426.08
应收申购款	51,535.73	380,373.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	133,298,457.08	90,684,807.10
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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	-	2,161,214.66
应付赎回款	2,344,271.13	361,711.92
应付管理人报酬	206,130.58	129,349.34
应付托管费	40,080.95	25,151.24
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	367,331.60	160,830.21
负债合计	2,957,814.26	2,838,257.37
所有者权益:		
实收基金	109,824,383.05	72,130,394.36
未分配利润	20,516,259.77	15,716,155.37
所有者权益合计	130,340,642.82	87,846,549.73
负债和所有者权益总计	133,298,457.08	90,684,807.10

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.187元,基金份额总额109,824,383.05份。

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:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	4,916,681.57	19,605,905.89
1.利息收入	62,005.45	30,964.87
其中:存款利息收入	62,005.45	30,964.87
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)	8,670,920.12	18,721,291.71
其中:股票投资收益	6,476,414.28	17,246,029.41
基金投资收益	-	10,080.19
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	2,194,505.84	1,465,182.11
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-3,023,068.88	1,262,499.05
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-953,391.07	-506,380.13
5.其他收入(损失以"-"号填列)	160,215.95	97,530.39
减:二、费用	4,845,098.85	3,666,561.40
1.管理人报酬	2,569,535.62	1,756,889.45
2.托管费	499,631.94	341,617.46
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,370,510.31	1,170,102.74
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	405,420.98	397,951.75
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	71,582.72	15,939,344.49
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	71,582.72	15,939,344.49

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:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	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)	-	71,582.72	71,582.72
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)	37,693,988.69	9,911,908.42	47,605,897.11
其中:1.基金申购款	157,372,403.65	34,354,827.78	191,727,233.43
2.基金赎回款	-119,678,416.96	-24,442,919.36	-144,121,336.32
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)	109,824,383.05	20,516,259.77	130,340,642.82
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	86,191,836.94	553,177.29	86,745,014.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,939,344.49	15,939,344.49
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)	-14,061,442.58	-776,366.41	-14,837,808.99
其中:1.基金申购款	73,846,593.46	5,556,957.01	79,403,550.47
2.基金赎回款	-87,908,036.04	-6,333,323.42	-94,241,359.46
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)	72,130,394.36	15,716,155.37	87,846,549.73

报表附注为财务报表的组成部分。

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:吴姚东　　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

7.4.1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

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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)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)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。

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	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
爆安股权投资有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
上海丰益股权投资基金有限公司	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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	14,485,500.97	2.26%	189,808,665.49	35.34%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3基金交易

无。

7.4.4.1.2应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31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	1.52%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	151,846.94	23.98%	-	-

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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,569,535.62	1,756,889.45
其中:支付销售机构的客户维护费	568,368.83	293,410.87

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×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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	499,631.94	341,617.46

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×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

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
期初持有的基金份额	30,002,000.00	30,002,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	30,002,000.00	30,002,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	27.32%	41.59%

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	1,650,540.80	58,627.48	3,587,842.89	27,651.53
渣打银行	5,045,499.67	3,001.27	7,045,021.36	3,027.86

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,按约定利率计息。7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 利润分配情况

本基金本期向基金份额持有人分配收益具体情况如下:

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	本期利润分配合计	备注
1	2014/01/15	2014/01/14	0.700	3,894,763.85	1,288,622.89	5,183,386.74	
合计				3,894,763.85	1,288,622.89	5,183,386.74	

注:本基金的基金管理人于资产负债表日后,报告批准报出日前宣告的利润分配情况,请参见附注7.4.8.2资产负债表日后事项。

7.4.6期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.6.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.6.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.7 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为121,223,033.37元,无属于第二层次和第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次79,670,324.00元,无第二层次和第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d) 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。

(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。

§8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	116,531,165.82