

广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金

2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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 2011 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5	信息披露方式.....	7
2.6	其他相关资料.....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	8
3.1	主要会计数据和财务指标.....	8
3.2	基金净值表现.....	8
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	11
4.3	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
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.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
注：	基金合同生效日期为 2011 年 8 月 18 日，无可比较期间数据。.....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	31
7.1	期末基金资产组合情况.....	31
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	32
7.3	期末按行业分类的权益投资组合.....	32
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.....	33
7.5	报告期内股票投资组合的重大变动.....	38

7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	41
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	41
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	41
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	41
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	41
7.11	投资组合报告附注	42
8	基金份额持有人信息	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	43
9	开放式基金份额变动	43
10	重大事件揭示	43
10.1	基金份额持有人大会决议	43
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	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	45
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	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	47
11	备查文件目录	50
11.1	备查文件目录	50
11.2	存放地点	51
11.3	查阅方式	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金
基金简称	广发亚太精选股票
基金主代码	270023
交易代码	270023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月18日
基金管理人	广发基金管理有限公司
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	174,950,340.50份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过在亚太区域内进行积极的资产配置和组合管理，有效分散基金的投资组合风险，实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	（一）资产配置策略 本基金的资产配置策略包括股票和债券等大类资产的配置及国家和地区间的资产配置。 本基金的股票资产及其它权益类资产占基金资产的比例为60%-95%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具的比例5%-40%。 本基金将至少80%的股票资产及其它权益类资产投资于亚太地区（除日本）证券市场以及在其它证券市场交易的亚太企业。亚太企业主要是指登记注册在亚太地区、在亚太地区证券市场进行交易或其主要业务收入或资产在亚太地区的企业。本基金将不高于20%的股票资产及其它权益类资产投资于超出前述投资范围的其他市场（包括日本）的企业。 （二）权益类投资策略 本基金通过分析全球经济发展趋势下亚太区域市场的投资特点，进行自上而下的国家和地区配置，在此基础上对公司及行业所处的基本面进行深入分析和把握，采取自下而上的个股精

	选策略实现合理的投资组合配置。 1、个股精选策略 本基金力图对公司及行业所处的基本面进行深入分析和把握，采取自下而上的个股精选策略实现合理的投资组合配置。 本基金个股选择策略由定量和定性两部分组成。 2、基金的投资策略 本基金对境外基金的投资，主要是作为股票投资的一种替代性投资工具。 （三）固定收益类投资策略 本基金固定收益类投资以分散投资风险和优化流动性管理为主要目标，一般不做主动性投资。 （四）衍生品投资策略 本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与金融衍生品投资，包括远期合约、掉期、期权、期货等，以实现投资组合风险管理。 （五）币种配置和外汇管理 本基金人民币与其他外币的转换目的是为了满足不同股票投资清算和应对赎回的需要，基金管理人将根据对汇率前景的预测、股票资产的地区配置要求，以及应对申购赎回的需要，对货币资产在港币、美元、日元、韩币、澳元、欧元、英镑、新币、人民币等币种之间进行配置。
业绩比较基准	摩根士丹利综合亚太(除日本)总收益指数（MSCI AC Asia Pacific ex Japan Total Return Index）。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。

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		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	赵会军
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	95105828, 020-83936999	95588
传真	020-89899158	010-66105798
注册地址	广东省珠海市拱北情侣南路 255 号 4 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	王志伟	姜建清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	-	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港中环德辅道中四至四 A 渣打银行大厦三十二楼 32/F., Standard Chartered Bank Building, 4-4A Des Voeux Road, Central, Hong Kong
办公地址		-	香港中环德辅道中四至四 A 渣打银行大厦三十二楼 32/F., Standard Chartered Bank Building, 4-4A Des Voeux Road, Central, Hong Kong
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

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（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,708,681.72
本期利润	-5,929,996.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0324
本期加权平均净值利润率	-3.20%
本期基金份额净值增长率	-3.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-635,611.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0036
期末基金资产净值	174,314,729.43
期末基金份额净值	0.996
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-0.40%

注：1、本基金合同生效日为 2010 年 8 月 18 日，至披露时点不满一年。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、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

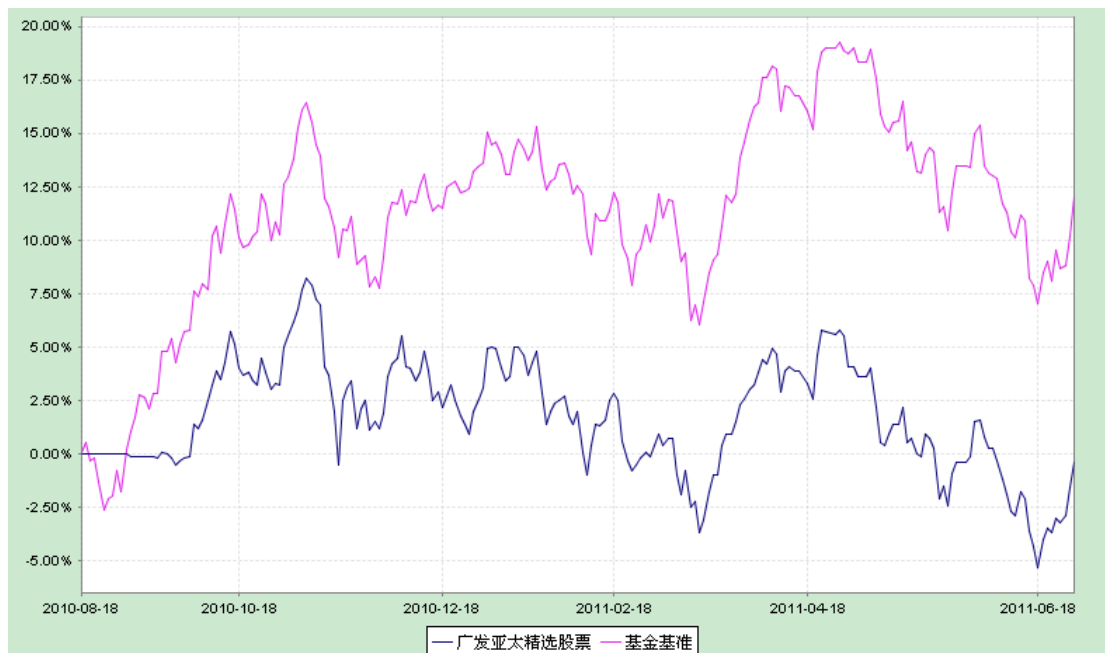
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-1.87%	0.85%	-2.57%	1.04%	0.70%	-0.19%
过去三个月	-2.92%	0.93%	-2.26%	1.00%	-0.66%	-0.07%
过去六个月	-3.39%	0.91%	-1.42%	0.98%	-1.97%	-0.07%
成立至今	-0.40%	0.88%	12.02%	0.95%	-12.42%	-0.07%

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

广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010 年 8 月 18 日至 2011 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2010 年 8 月 18 日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、香江投资有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司。公司具有企业年金投资管理人、QDII、特定资产管理业务资格和社保基金投资管理人资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 17 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、金融工程部、研究发展部、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、机构理财部、市场拓展部、国际业务部。此外，还设立了北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司和香港子公司（广发国际资产管理有限公司）。

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金管理人管理十九只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥保本混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金和广发标普全球农业指数证券投资基金，管理资产规模为 1022.81 亿元。同时，公司还管理着多个企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

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		
YongHua Pan	本基金的基金经理、公司总经理助理、国际业务部总经理	2010-10-29	-	15	男，美国籍，金融学博士，持有中国证券业执业证书，曾任职于美国雷曼兄弟公司（纽约），巴克莱投资银行（纽约），法国巴黎银行（纽约），BASSINI PLAYFAIR WRIGHT（纽约）和 SAC 资产管理公司（纽约），从事证券研究、交易和投资工作，2009 年 5 月起任广发基金管理有限公司国际业务部总经理，2010 年 10 月 29 日起任广发亚太精选股票(QDII)基金的基金经理，2011 年 1 月 6 日起任广发基金管理有限公司总经理助理。

注：1. 基金经理的“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 基金经理助理的“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3. 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

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

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

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

监察稽核部风险控制管理岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；监察稽核部稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

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

本基金管理人未管理与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人在投资管理活动中公平对待不同投资组合，未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年全球市场表现分化，受益于低通胀、宽松货币政策、QE2 的继续进行和良好的企业盈利增长，发达市场尤其是美国股市表现亮丽，而新兴市场普遍面对高通胀带来的紧缩压力，其中中国、印度、南韩等都延续 2010 年下半年之提高银行存款准备金率或加息或两者兼有的紧缩政策。总体上，相对成熟市场，新兴市场的表现相对较弱，波动比较大。上半年，全球市场受诸多突发性大型事件影响，比如日本地震海啸、中东及非洲局部动乱和战争、欧洲希腊主权债务危机等；各国市场备受冲击，风险偏好波动非常大。经济数据方面，美国经济增速总体上低于预期，其中 2011 年 1 季度 GDP 增长 3.1%，而 2 季度却只有 1.3%；中国虽然经济增速没有显著放慢，2011 年 1 季度 GDP 增长 9.7%，2 季度为 9.6%；但是经济先行指标的 PMI 指数却连续 4 个月录得下滑，中国的通货膨胀压力依旧较大，虽然市场预期通胀即将见顶。

2011 年上半年来看，纳斯达克综合指数涨幅 4.56%，标普 500 指数涨幅 5.03%，美国道琼斯工业平均指数涨幅 7.18%，韩国综合指数涨幅 2.43%，马来西亚吉隆坡指数涨幅 3.93%，印度孟买 Sensex30 指数下跌 5.46%，新加坡海峡指数上涨 2.17%，台湾加权指数下跌 3.57%，澳大利亚下跌 2.88%；国内上证综合指数下跌 1.6%；深证成份指数下跌 2.79%；沪深 300 涨幅下跌 2.69%。

鉴于市场波动风险显著扩大的特点，广发亚太精选显著减少了中小型股票的配置，更多配置于流动性好的大型蓝筹股票。同时，鉴于全球经济显露增长放缓迹象，本基金配置方面适当增加了防御性股票。广发亚太精选 2011 年上半年在国家区域配置方面，主要配置于香港、韩国、澳大利亚和印度市场。在行业配置方面，本基金更关注上游资源类、消费类、新能源类以及科技网络类。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期，本基金净值下跌 3.39%，比较基准下跌 1.42%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计未来全球经济总体保持稳定增长，增速比市场年初预期的略低。中国经济硬着陆的风险不大，有望继续温和放缓。全球市场有望继续保持区间震荡，我们对后市看法维持谨慎乐观。我们将继续重点关注上游资源，新能源、以及消费类股票。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。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，由其按合同约定提供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

本基金本报告期间未分配利润，本基金本期末可供分配利润为-635,611.07 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

2011 年上半年，本基金托管人在对广发亚太（除日本）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投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年，广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发亚太（除日本）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。本报告期内，广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金 2011 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：广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	30,094,468.78	27,916,042.19
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	144,784,670.38	218,552,687.23
其中：股票投资		128,164,456.75	198,632,704.68
基金投资		16,620,213.63	19,919,982.55
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	0.00	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,998.11	801.36
应收股利		302,519.43	-
应收申购款		22,158.97	63,071.25

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		175,205,815.67	246,532,602.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		397,553.96	10,873,599.55
应付管理人报酬		254,172.45	380,999.90
应付托管费		49,422.43	74,083.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	189,937.40	120,980.86
负债合计		891,086.24	11,449,663.63
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	174,950,340.50	227,944,763.35
未分配利润	6.4.7.10	-635,611.07	7,138,175.05
所有者权益合计		174,314,729.43	235,082,938.40
负债和所有者权益总计		175,205,815.67	246,532,602.03

注：1：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.996 元，基金份额总额 174,950,340.50 份。

6.2 利润表

会计主体：广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		-2,815,725.59	-

1.利息收入		33,420.79	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	33,420.79	-
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）		6,471,557.50	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,879,346.89	-
基金投资收益	6.4.7.13	980,930.76	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	25,405.91	-
股利收益	6.4.7.16	1,585,873.94	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,638,678.35	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-765,763.03	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	83,737.50	-
减：二、费用		3,114,271.04	-
1. 管理人报酬		1,661,070.44	-
2. 托管费		322,985.93	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	907,597.67	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	222,617.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,929,996.63	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,929,996.63	-

注：基金合同生效日期为 2011 年 8 月 18 日，无可比较期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	227,944,763.35	7,138,175.05	235,082,938.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,929,996.63	-5,929,996.63
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）	-52,994,422.85	-1,843,789.49	-54,838,212.34
其中：1. 基金申购款	12,136,842.42	13,893.76	12,150,736.18
2. 基金赎回款	-65,131,265.27	-1,857,683.25	-66,988,948.52
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）	174,950,340.50	-635,611.07	174,314,729.43
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金合同生效日为 2010 年 8 月 18 日，上年度可比区间无数据。

报告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：

基金管理公司负责人：王志伟，主管会计工作负责人：林传辉，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监基金字[2010]644号《关于同意广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发亚太(除日本)精选股票型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2010年8月18日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,境外资产托管人为渣打银行(香港)有限公司(Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited)。本基金已向中国证券监督管理委员会备案,并于2010年8月18日获得确认。

本基金募集期为2010年7月19日至2010年8月16日,本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集为人民币540,598,089.38元,有效认购户数为6,610户。其中,认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币23,922.99元,折合基金份额23,922.99份,按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所有限公司验资。基金合同于2010年8月18日生效,基金合同生效日的基金份额总额为540,598,089.38份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围包括股票及其他权益类证券(包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等);现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具(包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具);政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。本基金投资的主要区域为亚太地区(除日本),包括韩国、印度、台湾、香港、澳大利亚、新西兰、新加坡、印度尼西亚、泰国、马来西亚和菲律宾等国家或地区。本基金将至少80%的股票资产及其它权益类资产投资于亚太地区(除日本)证券市场以及在其它证券市场交易的亚

太企业，本基金将不高于 20%的股票资产及其它权益类资产投资于超出前述投资范围的其他市场(包括日本)的企业。本基金的业绩比较基准采用：摩根士丹利综合亚太(除日本)总收益指数(MSCI AC Asia Pacific ex Japan Total Return Index)。

本基金的财务报表于 2011 年 8 月 26 日已经本基金的管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金执行企业会计准则、基金合同、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号<年度报告和半年度报告>》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《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、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、基金取得的源自境外的收入，其涉及的境外所得税，按照相关国家或地区相关税收法律和法规执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	30,094,468.78
定期存款	-
其他存款	-
合计	30,094,468.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		119,957,162.03	128,164,456.75	8,207,294.72
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	债券合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		16,275,246.24	16,620,213.63	344,967.39
其他		-	-	-
合计		136,232,408.27	144,784,670.38	8,552,262.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	0.00	0.00	0.00	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本基金报告期内获配取得 XIWAW1 HK 认股权证，取得成本为 0.00 元，由于报告期末行权价格高于西王糖业股票收盘价，权证估值价格为 0.00 元。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,998.11
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,998.11

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,498.30
应付审计费	39,671.58
应付信息披露费	148,767.52
合计	189,937.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	227,944,763.35	227,944,763.35
本期申购	12,136,842.42	12,136,842.42
本期赎回（以“-”号填列）	-65,131,265.27	-65,131,265.27
本期末	174,950,340.50	174,950,340.50

6.4.7.10 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	192,531.09	6,945,643.96	7,138,175.05
本期利润	2,708,681.72	-8,638,678.35	-5,929,996.63
本期基金份额交易产生的变动数	-1,055,206.63	-788,582.86	-1,843,789.49
其中：基金申购款	425,046.99	-411,153.23	13,893.76
基金赎回款	-1,480,253.62	-377,429.63	-1,857,683.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,846,006.18	-2,481,617.25	-635,611.07

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	33,170.45
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	250.34
合计	33,420.79

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	209,284,691.15
减：卖出股票成本总额	205,405,344.26
买卖股票差价收入	3,879,346.89

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	23,138,886.40
减：卖出/赎回基金成本总额	22,157,955.64
基金投资收益	980,930.76

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	87,021.56
减：卖出权证成本总额	61,615.65
基金投资收益	25,405.91

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,499,663.82
基金投资产生的股利收益	86,210.12
合计	1,585,873.94

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,638,678.35
——股票投资	-7,186,602.94
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-1,452,075.41
2. 衍生工具	0.00
——权证投资	0.00
3. 其他	-
合计	-8,638,678.35

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	83,737.50
基金转换费收入	-
其他	-
合计	83,737.50

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	907,597.67
银行间市场交易费用	-
合计	907,597.67

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	235.00
账户维护费	4,500.00
其他	29,442.90
合计	222,617.00

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本基金本报告期新增关联方广发国际资产管理有限公司(GF International Investment Management Limited)，为基金管理人的全资子公司。

6.4.9.2 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
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
渣打银行（香港）有限公司	基金境外资产托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,661,070.44	-
其中：支付销售机构的客户 维护费	253,426.14	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.8% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首二个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	322,985.93	-

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首二个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
期初持有的基金份额	40,000,400.01	-
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	40,000,400.01	-
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	22.86%	-

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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 股份有限公司	9,854,799.46	23,625.68	-	-
渣打银行(香 港)有限公司	20,239,669.32	9,795.11	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和境外资产托管人渣打银行(香港)有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，除前文所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金

所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

对流动性风险的监控和管理，本基金管理人根据对市场特征和发展形势等方面的分析和判断，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型 (VAR) 等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 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	30,094,468.78	-	-	-	30,094,468.78
交易性金融 资产	-	-	-	144,784,670.38	144,784,670.38
应收利息	-	-	-	1,998.11	1,998.11
应收股利	-	-	-	302,519.43	302,519.43
应收申购款	22,158.97	-	-	-	22,158.97
资产总计	30,116,627.75	-	-	145,089,187.92	175,205,815.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	397,553.96	397,553.96
应付管理人 报酬	-	-	-	254,172.45	254,172.45

应付托管费	-	-	-	49,422.43	49,422.43
其他负债	-	-	-	189,937.40	189,937.40
负债总计	-	-	-	891,086.24	891,086.24
利率敏感度 缺口	30,116,627.75	-	-	144,198,101.68	174,314,729.43
上年度末 2010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	27,916,042.19	-	-	-	27,916,042.19
交易性金融 资产	-	-	-	218,552,687.23	218,552,687.23
应收利息	-	-	-	801.36	801.36
应收申购款	63,071.25	-	-	0.00	63,071.25
资产总计	27,979,113.44	-	-	218,553,488.59	246,532,602.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,873,599.55	10,873,599.55
应付管理人 报酬	-	-	-	380,999.90	380,999.90
应付托管费	-	-	-	74,083.32	74,083.32
其他负债	-	-	-	120,980.86	120,980.86
负债总计	-	-	-	11,449,663.63	11,449,663.63
利率敏感度 缺口	27,979,113.44	-	-	207,103,824.96	235,082,938.40

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011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

银行存款	17,426,530.98	2,813,138.34	-	20,239,669.32
交易性金融资产	21,884,653.78	75,712,046.09	47,187,970.51	144,784,670.38
资产合计	39,311,184.76	78,525,184.43	47,187,970.51	165,024,339.70
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	39,311,184.76	78,525,184.43	47,187,970.51	165,024,339.70
项目	上年度末 2010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
银行存款	13,979,064.96	12,022,786.28	-	26,001,851.24
交易性金融资产	47,477,666.11	101,868,449.87	69,206,571.25	218,552,687.23
资产合计	61,456,731.07	113,891,236.15	69,206,571.25	244,554,538.47
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	61,456,731.07	113,891,236.15	69,206,571.25	244,554,538.47

6.4.13.4.2.2 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）	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	8,251,216.99	12,227,726.92
	所有外币相对人民币贬值 5%	-8,251,216.99	-12,227,726.92

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市

价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 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	128,164,456.75	73.52	198,632,704.68	84.49
交易性金融资产-基金投资	16,620,213.63	9.53	19,919,982.55	8.47
衍生金融资产-权证投资	0.00	0.00	-	-
其他			-	-
合计	144,784,670.38	83.06	218,552,687.23	92.97

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准（摩根士丹利综合亚太（除日本）总收益指数（MSCI AC Asia Pacific ex Japan Total Return Index））变化且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）	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	6,371,614.38	10,849,077.61
	业绩比较基准下降5%	-6,371,614.38	-10,849,077.61

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

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	128,164,456.75	73.15
	其中：普通股	116,893,641.15	66.72

	存托凭证	11,270,815.60	6.43
2	基金投资	16,620,213.63	9.49
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	0.00	0.00
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	30,094,468.78	17.18
8	其他各项资产	326,676.51	0.19
9	合计	175,205,815.67	100.00

注：本基金报告期内获配取得 XIWAW1 HK 认股权证，取得成本为 0.00 元，由于报告期末行权价格高于西王糖业股票收盘价，权证估值价格为 0.00 元。

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	69,705,670.64	39.99
美国	11,270,815.60	6.47
澳大利亚	19,076,368.66	10.94
韩国	25,166,323.13	14.44
新加坡	2,381,776.54	1.37
印度尼西亚	563,502.18	0.32
合计	128,164,456.75	73.52

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、上述美国比重包括印度和中国在美国上市的 ADR。

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	10,176,533.94	5.84
材料	44,312,750.34	25.42
工业	4,702,474.92	2.70
非必须消费品	20,526,716.82	11.78
必须消费品	10,303,802.49	5.91
保健	8,592,130.53	4.93
金融	17,108,851.96	9.81
信息技术	7,909,698.37	4.54
电信服务	2,095,682.40	1.20
公用事业	2,435,814.98	1.40
合计	128,164,456.75	73.52

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	DOCTOR REDDY'S LAB-ADR	-	RDY US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	38,000	8,442,461.06	4.84
2	LG CHEM LTD	LG 化学有限公司	051910 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	2,000	5,915,783.09	3.39
3	RIO TINTO LTD	力拓有限公司	RIO AU	澳 大 利 亚 证 券 交 易 所	澳大利亚	9,800	5,635,485.14	3.23
4	KOREA KUMHO PETROCHEMICAL CO	--	011780 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	3,600	5,127,820.17	2.94
5	NEWCREST MINING LTD	纽克雷斯特矿业有限	NCM AU	澳 大 利 亚 证 券	澳大利亚	19,436	5,078,586.94	2.91

		公司		交易所				
6	HENGAN INTL GROUP CO LTD	恒安国际	1044 HK	香港证券交易所	中国香港	80,000	4,643,766.08	2.66
7	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	中国山水水泥集团	691 HK	香港证券交易所	中国香港	600,000	4,485,758.28	2.57
8	LYNAS CORP LTD	-	LYC AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	310,000	4,253,107.43	2.44
9	HYUNDAI MOBIS	现代精工	012330 KS	韩国证券交易所	韩国	1,700	4,121,652.15	2.36
10	CNOOC LTD	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	中国香港	260,000	3,926,576.99	2.25
11	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	914 HK	香港证券交易所	中国香港	120,000	3,632,516.16	2.08
12	HONAM PETROCHEMICAL CORP	湖南石油化学公司	011170 KS	韩国证券交易所	韩国	1,500	3,595,838.44	2.06
13	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香港证券交易所	中国香港	130,000	3,200,073.76	1.84
14	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	3988 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	3,151,839.80	1.81
15	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	3,126,891.20	1.79

16	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	-	005930 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩国	600	3,003,957.07	1.72
17	I.T LTD	-	999 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	450,000	2,829,171.24	1.62
18	INFOSYS LTD-SP ADR	-	INFY US	纳 斯 克 达 证 券 交 易 所	美国	6,700	2,828,354.54	1.62
19	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	建 设 银 行	939 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	500,000	2,681,974.50	1.54
20	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	中 银 香 港	2388 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	140,000	2,631,245.68	1.51
21	SINGAPORE EXCHANGE LTD	-	SGX SP	新 加 坡 证 券 交 易 所	新加 坡	60,000	2,381,776.54	1.37
22	SHENGUAN HOLDINGS GROUP LTD	神 冠 股 份	829 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	500,000	2,286,955.00	1.31
23	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	六 福 集 团	590 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	70,000	2,197,555.85	1.26
24	INTERNATIONAL MINING MACHIN	国 际 煤 机	1683 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	350,000	2,174,270.49	1.25
25	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中 国 神 华	1088 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	70,000	2,159,717.14	1.24
26	BHP BILLITON LTD	必 和 必 拓 有 限	BHP AU	澳 大 利 亚	澳大利 亚	7,000	2,124,474.97	1.22

		公司		证 券 交 易 所				
27	CHINA RESOURCES ENTERPRISE	华 润 创 业	291 HK	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	80,000	2,115,641.28	1.21
28	CHINA TELECOM CORP LTD-H	中 国 电 信	728 HK	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	500,000	2,095,682.40	1.20
29	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	百 丽	1880 HK	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	150,000	2,045,785.20	1.17
30	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	株 洲 南 车	3898 HK	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	90,000	1,964,702.25	1.13
31	TRINITY LTD	立 邦	891 HK	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	300,000	1,953,475.38	1.12
32	HYUNDAI MOTOR CO	现 代 汽 车 公 司	005380 KS	韩 国 证 券 交 易 所	韩 国	1,300	1,867,472.10	1.07
33	ATLAS IRON LTD	Atlas 铁 矿 有 限 公 司	AGO AU	澳 大 利 亚 证 券 交 易 所	澳 大 利 亚	71,000	1,835,044.71	1.05
34	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	华 润 燃 气	1193 HK	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	200,000	1,809,605.12	1.04
35	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安 踏 体 育 用 品	2020 HK	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	150,000	1,733,927.70	0.99
36	KIA MOTORS CORPORATION	起 亚 汽 车 公 司	000270 KS	韩 国 证 券 交 易	韩 国	3,500	1,533,800.11	0.88

				所				
37	SOHO CHINA LTD	SOHO 中国	410 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	254,000	1,468,058.79	0.84
38	DONGYUE GROUP	东 岳 集 团	189 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	200,000	1,420,406.96	0.81
39	ZTE CORP-H	中 兴 通 讯	763 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	60,000	1,407,101.04	0.81
40	JIANGXI COPPER CO LTD-H	江 西 铜 业	358 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	50,000	1,074,868.85	0.62
41	WHARF HOLDINGS LTD	九 龙 仓 集团	4 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	22,000	988,879.34	0.57
42	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	大 家 乐 集团	341 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	60,000	947,048.86	0.54
43	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆 仑 能 源	135 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	80,000	890,166.05	0.51
44	DAH CHONG HONG	大 昌 行 集团	1828 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	100,000	771,743.36	0.44
45	MAGIC HOLDINGS INTERNATIONAL	美 即 控 股	1633 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	201,065	712,313.22	0.41
46	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香 港 交 易 所	388 HK	香 港 证 券 交 易 所	中国 香港	5,000	678,186.11	0.39
47	GCL-POLY ENERGY	保 利 协 鑫 能 源	3800 HK	香 港 证 券	中国 香港	200,000	670,285.72	0.38

	HOLDINGS LTD			交易所				
48	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	龙源电力	916 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	626,209.86	0.36
49	UNITED TRACTORS TBK PT	-	UNTR IJ	印度尼西亚证券交易所	印度尼西亚	30,000	563,502.18	0.32
50	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	维达纸业	3331 HK	香港证券交易所	中国香港	75,000	545,126.91	0.31
51	CARPENTER TAN HOLDINGS LTD	谭木匠	837 HK	香港证券交易所	中国香港	164,000	525,084.87	0.30
52	COCHLEAR LTD	科利耳有限公司	COH AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	300	149,669.47	0.09
53	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	招金矿业股份	1818 HK	香港证券交易所	中国香港	10,000	133,059.20	0.08

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

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	CNOOC LTD	883 HK	6,734,224.60	2.86
2	HONAM PETROCHEMICAL CORP	011170 KS	6,498,924.30	2.76
3	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	6,119,424.84	2.60

4	LG CHEM LTD	051910 KS	4,048,162.44	1.72
5	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	3,996,762.00	1.70
6	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP	691 HK	3,889,693.85	1.65
7	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	3,867,865.20	1.65
8	RENESOLA LTD-ADR	SOL US	3,638,760.15	1.55
9	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	TTM US	3,571,818.34	1.52
10	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	3,423,432.60	1.46
11	LUK FOOK HOLDINGS INTL LTD	590 HK	3,366,674.67	1.43
12	KOREA KUMHO PETROCHEMICAL CO	011780 KS	3,348,954.13	1.42
13	I.T LTD	999 HK	3,316,655.82	1.41
14	YANZHOU COAL MINING CO-H	1171 HK	3,307,006.58	1.41
15	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	3,191,462.40	1.36
16	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	3,118,500.09	1.33
17	CANADIAN SOLAR INC	CSIQ US	2,977,391.60	1.27
18	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	2,919,367.41	1.24
19	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	2,853,652.87	1.21
20	YINGLI GREEN ENERGY HOLD-ADR	YGE US	2,731,897.21	1.16

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出

金额”（或“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。

7.5.2 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	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	13,888,183.07	5.91
2	CNOOC LTD	883 HK	13,730,869.29	5.84
3	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3800 HK	13,427,430.78	5.71
4	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	TTM US	11,421,271.96	4.86
5	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	10,293,848.89	4.38
6	LG CHEM LTD	051910 KS	6,687,153.30	2.84
7	YINGLI GREEN ENERGY HOLD-ADR	YGE US	6,686,906.23	2.84
8	OZ MINERALS LTD	OZL AU	6,496,660.35	2.76
9	AMOREPACIFIC CORP	090430 KS	6,211,983.96	2.64
10	361 DEGREES INTERNATIONAL	1361 HK	6,028,271.01	2.56
11	RIO TINTO LTD	RIO AU	5,961,068.80	2.54
12	CHINA SHINEWAY PHARMACEUTICA	2877 HK	5,668,938.24	2.41
13	APPLE INC	AAPL US	5,494,420.03	2.34
14	JIANGXI COPPER CO LTD-H	358 HK	5,104,861.38	2.17
15	MACQUARIE GROUP LTD	MQG AU	5,084,538.81	2.16
16	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1818 HK	5,036,499.29	2.14
17	HONAM PETROCHEMICAL CORP	011170 KS	4,928,436.47	2.10
18	HYUNDAI MOBIS	012330 KS	4,498,778.71	1.91
19	GUANGZHOU PHARMACEUTICAL-H	874 HK	3,768,518.48	1.60
20	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	3,754,069.00	1.60

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	142,123,699.27
卖出收入（成交）总额	209,284,691.15

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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	认购权证	XIWAW1 HK	0.00	0.00
2	-	-	-	-
3	-	-	-	-
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-

注：本基金报告期内获配取得 XIWAW1 HK 认股权证，取得成本为 0.00 元，由于报告期末行权价格高于西王糖业股票收盘价，权证市价为 0.00 元。

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	ISHARES MSCI MALAYSIA	ETF 基金	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors（贝莱德基金顾问公司）	4,627,867.05	2.65
2	MARKET VECTORS	ETF 基金	契约型开放式	Van Eck Associates Corp	3,725,311.82	2.14

	INDONESIA IND					
3	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF	ETF 基金	契约型开放 式	Hang Seng Investment Management Limited(恒生投 资管理有限公司)	3,155,997.90	1.81
4	TRACKER FUND OF HONG KONG	ETF 基金	契约型开放 式	StateStreet Global Advisors (道富环球投资 管理公司)	2,850,377.55	1.64
5	ISHARES S&P INDIA NIFTY 50 I	ETF 基金	契约型开放 式	BlackRock Fund Advisors (贝莱 德基金顾问公 司)	2,260,659.31	1.30
6	-	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	302,519.43
4	应收利息	1,998.11
5	应收申购款	22,158.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	326,676.51

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
2,835	61,710.88	40,001,400.00	22.86%	134,948,940.50	77.14%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	6,217,192.84	3.5537%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 8 月 18 日）基金份额总额	540,598,089.38
本报告期期初基金份额总额	227,944,763.35
本报告期基金总申购份额	12,136,842.42
减：本报告期基金总赎回份额	65,131,265.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	174,950,340.50

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，基金管理人重大人事变动：

1. 董事长、法定代表人变更

因我司第三届董事会任期届满，原董事长马庆泉因年龄原因不再任职。2011 年 3 月 16 日，经我司第四届董事会第一次会议审议通过，选举王志伟为广发基金管理有限公司董事长。在中国证监会核准王志伟的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后，该任职事项方正式生效。董事会授权公司副董事长、总经理林传辉在中国证监会核准拟任董事长的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项前，代为履行董事长职责。代为履行职责的时间不得超过 90 日，法律、行政法规另有规定的除外。

2011 年 6 月 15 日，公司在指定信息披露媒体刊登了《基金行业高级管理人员变更公告》，披露因我司拟任董事长王志伟先生的高级管理人员任职资格尚处于报批阶段，在其高管任职资格获准前，继续由公司副董事长、总经理林传辉先生代为履行董事长职责。2011 年 7 月 19 日，公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司王志伟基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2011]1119 号）。中国证监会核准了王志伟的基金行业高级管理人员任职资格，并对王志伟任我司董事长无异议。自 2011 年 7 月 19 日起，王志伟正式履行董事长职务。

2011 年 8 月 5 日，我司完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任董事长王志伟。

2. 聘任副总经理

2011 年 3 月 16 日，经我司第四届董事会第一次会议审议通过，董事会新聘任易阳方担任我司副总经理。在中国证监会核准易阳方的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后，该任职事项方正式生效。

2011 年 8 月 11 日，公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司易阳方基金行业高级管理人员任职资格的批复》（证监许可[2011]1267 号），中国证监会核准了易阳方的基金行业高级管理人员任职资格，并对易阳方任公司副总经理无异议。

自 2011 年 8 月 11 日起，易阳方副总经理任职正式生效。

本报告期内，基金托管人托管业务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

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

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

金额单位：人民币元

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	
China International Capital Corporation Limited	-	48,999,020.76	14.24%	79,610.50	13.99%	-
KGI Asia Limited	-	2,468,823.42	0.72%	3,703.24	0.65%	-
China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-
BOC International Securities	-	17,111,791.79	4.97%	25,667.70	4.51%	-

Limited						
BOCOM International Securities Limited	-	6,924,991.55	2.01%	10,664.99	1.87%	-
CIMB Securities (HK) Ltd.	-	6,254,436.28	1.82%	9,381.67	1.65%	-
United Bank of Switzerland	-	67,083,681.64	19.50%	107,577.35	18.91%	-
Shenyin Wanguo Securities (H. K.) Limited	-	5,584,639.30	1.62%	8,376.96	1.47%	-
Deutsche Bank AG	-	16,530,098.68	4.81%	33,060.20	5.81%	-
Morgan Stanley	-	60,316,705.55	17.53%	85,578.57	15.04%	-
Goldman Sachs Group Inc.	-	26,413,135.11	7.68%	76,921.04	13.52%	-
Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	6,168,692.59	1.79%	8,327.75	1.46%	-
GF Holdings (Hong Kong) Corporation Limited	-	29,529,868.54	8.58%	29,543.80	5.19%	-
Haitong International Securities Group Limited	-	280,088.57	0.08%	280.09	0.05%	-
Pingan of China Securities (Hong Kong)	-	340,765.96	0.10%	511.15	0.09%	-
Piper Jaffray Asia Securities Limited	-	3,176,276.88	0.92%	3,811.60	0.67%	-
Woori Investment	-	1,926,173.40	0.56%	3,467.11	0.61%	-

and Securities						
Daewoo Securities Co., Ltd.	-	3,753,942.50	1.09%	7,507.88	1.32%	-
Daishin Securities Co., Ltd.	-	1,683,297.60	0.49%	3,029.94	0.53%	-
Shinhan Investment Corporation	-	11,413,450.49	3.32%	19,402.83	3.41%	-
Samsung Securities Co., Ltd.	-	15,091,087.54	4.39%	30,182.10	5.30%	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	新增
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	-	1,242,788.69	0.36%	1,864.18	0.33%	-
CSC Capital Group	-	723,532.78	0.21%	723.53	0.13%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	4,074,642.34	9.38%

KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCOM International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	3,739,988.03	8.61%-
CIMB Securities (HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
United Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	10,684,804.08	24.59%-
Shenyin Wanguo Securities (H. K.) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	12,910,689.82	29.71%
Goldman Sachs Group Inc.	-	-	-	-	-	-	12,039,024.28	27.71%-
Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Holdings (Hong Kong) Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Group Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Pingan of China	-	-	-	-	-	-	-	-

Securities (Hong Kong)								
Piper Jaffray Asia Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Woori Investment and Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Daewoo Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
Daishin Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
Shinhan Investment Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
Samsung Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Limited								
UOB Kay Hian (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CSC Capital Group	-	-	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于增加财达证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-01-24
2	广发基金管理有限公司关于广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金暂停申购赎回业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-01-24
3	广发基金管理有限公司关于增加哈尔滨银	《中国证券报》、《证券时	2011-02-14

	行为基金代销机构的公告	报》、《上海证券报》	
4	广发基金管理有限公司关于广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金 2011 年交易市场休市日暂停申购赎回的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-02-24
5	广发基金管理有限公司关于调整旗下基金通过中信建投证券定期定额投资申购起点金额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
6	广发基金管理有限公司关于开展中国工商银行借记卡网上直销（含定期定额投资）申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
7	广发基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-03-17
8	广发基金管理有限公司关于增加红塔证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》	2011-03-17
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加东莞银行网上银行及定期定额方式申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-01
10	广发基金管理有限公司关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-01
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加“华夏银行·盈基金 2011”网上银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-06
12	广发基金管理有限公司关于增加国金证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-12
13	广发基金管理有限公司关于增加中天证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
14	广发基金管理有限公司关于增加浙江稠州商业银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
15	广发基金管理有限公司关于增加联讯证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-05-03
16	广发基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券推出定期定额投资等业务公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-05-11

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金募集的文件；
2. 《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金基金合同》；
3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4. 《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金托管协议》；

5. 《广发亚太（除日本）精选股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版；
6. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一一年八月二十九日