

博时大中华亚太精选股票证券投资基金
2020 年中期报告
2020 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：二〇二〇年八月三十一日

§ 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。本中期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 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 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	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 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	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§7 投资组合报告	26
7.1 期末基金资产组合情况	26
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	27
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	28
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	31
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	33
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	33
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	33
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	33
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	33
7.11 投资组合报告附注	33
§8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	34
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	34
§9 开放式基金份额变动	34
§10 重大事件揭示	35

10.1 基金份额持有人大会决议	35
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	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	35
10.4 基金投资策略的改变	35
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	35
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	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	35
10.8 其他重大事件	37
§ 11 备查文件目录	38
11.1 备查文件目录	38
11.2 存放地点	38
11.3 查阅方式	38

§ 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	78,942,078.09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		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21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益田路	北京市西城区复兴门内大街55号

	5999号基金大厦21层	
邮政编码	518040	100140
法定代表人	江向阳	陈四清

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
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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	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(2020年1月1日至2020年6月30日)
本期已实现收益	-10,262,521.93
本期利润	-5,420,566.14
加权平均基金份额本期利润	-0.0473
本期加权平均净值利润率	-3.97%
本期基金份额净值增长率	1.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-22,804,148.82
期末可供分配基金份额利润	-0.2889
期末基金资产净值	101,119,874.30
期末基金份额净值	1.281
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	37.33%

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。

期末可供分配利润是指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。

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。

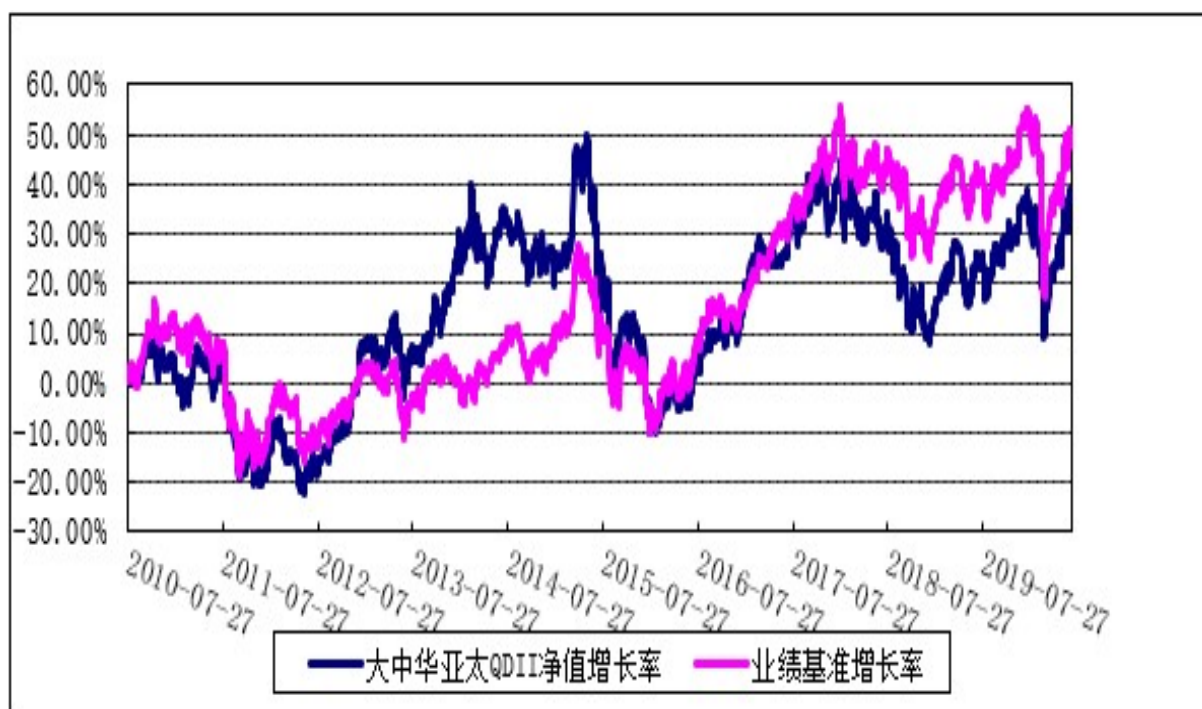
3.2 基金净值表现

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	6.66%	1.20%	5.71%	1.21%	0.95%	-0.01%
过去三个月	16.03%	1.28%	13.84%	1.28%	2.19%	0.00%
过去六个月	1.67%	1.60%	-2.19%	1.59%	3.86%	0.01%
过去一年	11.10%	1.24%	4.86%	1.21%	6.24%	0.03%
过去三年	9.30%	1.16%	13.79%	1.00%	-4.49%	0.16%
过去五年	4.40%	1.22%	27.29%	1.02%	-22.89%	0.20%
自基金合同生效起至今	37.33%	1.17%	48.05%	1.01%	-10.72%	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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 只公募基金，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、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020 “Best of the Best Awards” 三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang），博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报“开放 普惠 科技”2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

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		
牟星海	权益投资国际组负责人/基金经理	2020-05-21	-	26.8	牟星海先生，硕士。1993 年起先后在美国保诚金融控股公司、美银证券、美国雷曼兄弟控股公司、光大

					控股公司、布鲁克投资公司、先锋投资合伙企业、申万宏源（香港）公司、新韩法国巴黎资产管理公司、申万宏源（香港）公司从事研究、投资、管理等工作。2019 年加入博时基金管理有限公司。现任权益投资国际组负责人兼博时沪港深成长企业混合型证券投资基金（2019 年 6 月 10 日一至今）、博时大中华亚太精选股票证券投资基金（2020 年 5 月 21 日一至今）的基金经理。
杨涛	基金经理	2017-11-29	-	14.0	杨涛先生，硕士。2006 年起先后在瑞士银行集团、成都市绿色地球环保有限公司、建银国际（中国）有限公司、中国投资有限责任公司、里昂证券（原中信证券国际）工作。2017 年加入博时基金管理有限公司。现任博时大中华亚太精选股票证券投资基金（2017 年 11 月 29 日一至今）、博时沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金（2018 年 6 月 22 日一至今）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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 93 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有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的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

大中华亚太精选基金五月下旬有基金经理变更。目前基金运营正常，重仓可选和必选消费，互联网，科技，医疗等行业之龙头企业。上半年突发的新冠疫情给很多消费及服务类企业带来了不同程度的冲击和影响。除此外，我们也看好中概股回归港股的历史机会，基金也参与了一些新股的投资机会。未来一年对港股及亚太市场相对乐观。

今年的市场焦点在于全球疫情的发展和控制在，下半年还将加上美国大选及日益变化的中美关系。截止六月底，国内疫情除部分地区外都已基本可控，现有确诊人数很少。但全球疫情还处于上升期并无放缓迹象，美国，巴西，俄罗斯及印度等地高发及继续上升，欧盟国家由于有效控制已过高峰期。在此背景下，美联储降息基本至零，并开启无限量 QE，除美联储大幅宽松外，美国财政支持已达数万亿，幅度前所未有，加上欧美复工复产计划，全球央行快速跟进效仿，股市受益并快速反弹。流动性宽松直接导致估值膨胀，使得股市和实体经济短期脱节。这次疫情是一场前所未有的公共卫生安全冲击，直接导致经济活动的休克停止，影响资本市场的信心。由于疫情继续蔓延，实体经济正进入一个生活在疫情中的“新常态”。如此推断，医疗设备，包括电商在内的互联网经济，远程办公，必选消费，非银金融，与地产相关的建筑建材等行业都有相对较好。中国的科技国产化替代正处于上半期阶段，整体经济由量换质，业绩估值双提升的可能性较大。

港股及亚太地区股市都属于价值洼地，目前东亚实体经济已基本回到相对稳定阶段，抗疫成绩明显好于西方国家，复工复产正常有序。股市在全球范围内属于非常有吸引力的。亚太地区经济上和中国深度依靠。股市中价值，成长及创新等各类机会都有，整体经济恢复领先于全球其他区域和国家，有强有力的出口能力。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.281 元，份额累计净值为 1.363 元。报告期内，

本基金基金份额净值增长率为 1.67%，同期业绩基准增长率-2.19%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度和下半年，继续在不确定中寻找确定性机会。除了关注全球防疫控制及对出口密集型企业（中日韩为主）的影响，将进一步分析国家政策重点及运用资源刺激周期性经济指标。预测股市还是震荡向上。继续看好大中华及亚太地区资产，在全球停产时期制造业产能最先恢复，政府财政及货币宽松政策精准到位，经济复苏周期领先于欧美并起到典范作用，因此亚太地区股市在下半年应该得到全球机构投资者（包括南下资金）的青睐和追求。

下半年策略将偏向于内需和价值，以互联网新经济，新能源汽车，光伏，医疗消费等为主线，适当增加周期股的配置，包括金融，基建，地产等板块。积极参与港股新股投资机会。偏向于基本面稳健，下跌风险可控，短期和长期优势明显，分红率较高，商业模式优质的公司。保持中高仓位的运营。关注的主要风险包括美国总统大选前的对华政策，疫情在中国及亚太地区的二次爆发，等等。

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债金融估值中心有限公司签署服务协议，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

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

本报告期内，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未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期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 2020 年中期报告中财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	8,036,396.82	24,953,289.99
结算备付金		223,648.49	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	92,275,893.88	159,846,302.30
其中：股票投资		92,275,893.88	157,995,114.11
基金投资		-	1,851,188.19

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		2,943,823.22	973,118.41
应收利息	6.4.3.5	571.94	1,143.67
应收股利		407,642.92	41,680.30
应收申购款		227,701.86	53,742.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		104,115,679.13	185,869,277.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		302,137.36	2,691,926.99
应付赎回款		2,269,945.57	1,243,048.43
应付管理人报酬		146,785.92	276,730.23
应付托管费		28,541.70	53,808.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	46,540.10	36,523.19
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	201,854.18	160,421.11
负债合计		2,995,804.83	4,462,458.62
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	78,942,078.09	143,943,531.06
未分配利润	6.4.3.10	22,177,796.21	37,463,287.98
所有者权益合计		101,119,874.30	181,406,819.04
负债和所有者权益总计		104,115,679.13	185,869,277.66

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.281 元，基金份额总额 78,942,078.09 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
一、收入		-3,142,565.46	23,435,935.14
1. 利息收入		22,203.69	20,652.39
其中：存款利息收入	6.4.3.11	22,203.69	20,652.39

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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-8,434,967.72	3,045,763.28
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-9,303,126.65	57,283.69
基金投资收益	6.4.3.13	-45,294.48	417,931.05
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	913,453.41	2,570,548.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	4,841,955.79	20,425,057.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		420,830.61	-65,776.10
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	7,412.17	10,238.40
减：二、费用		2,278,000.68	2,303,885.25
1. 管理人报酬		1,224,563.17	1,677,156.60
2. 托管费		238,109.47	326,113.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	703,223.12	206,796.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	1,504.54
7. 其他费用	6.4.3.19	112,104.92	92,313.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,420,566.14	21,132,049.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,420,566.14	21,132,049.89

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	143,943,531.06	37,463,287.98	181,406,819.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,420,566.14	-5,420,566.14
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）	-65,001,452.97	-9,864,925.63	-74,866,378.60
其中：1. 基金申购款	12,038,602.18	2,283,536.55	14,322,138.73

2. 基金赎回款	-77,040,055.15	-12,148,462.18	-89,188,517.33
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）	78,942,078.09	22,177,796.21	101,119,874.30
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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）	182,508,119.85	5,377,462.66	187,885,582.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,132,049.89	21,132,049.89
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）	-22,013,601.59	-1,951,467.20	-23,965,068.79
其中：1. 基金申购款	3,163,236.68	355,551.79	3,518,788.47
2. 基金赎回款	-25,176,838.27	-2,307,018.99	-27,483,857.26
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）	160,494,518.26	24,558,045.35	185,052,563.61

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[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》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	8,036,396.82
定期存款	-
其他存款	-
合计	8,036,396.82

注：于 2020 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 2,470,082.00 (折合人民币 2,256,271.70 元)，日元 9,821,096.00 (折合人民币 646,306.69 元)，美元 640.02 元 (折合人民币 4,531.02 元)，新台币 5,323.56 元 (折合人民币 1,275.36 元)，新加坡元 56.76 元 (折合人民币 287.99 元)，澳元 7.69 元 (折合人民币 37.49 元)，韩元 1637.00 元 (折合人民币 9.64 元)，泰铢 0.14 元 (折合人民币 0.03)。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	82,042,762.47	92,275,893.88	10,233,131.41
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	82,042,762.47	92,275,893.88	10,233,131.41

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 2020年6月30日
应收活期存款利息	555.59
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	16.35
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	571.94

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	-
佣金	46,540.10
合计	46,540.10

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,291.06
应付证券出借违约金	-
预提费用	199,563.12
合计	201,854.18

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	143,943,531.06	143,943,531.06
本期申购	12,038,602.18	12,038,602.18
本期赎回(以“-”号填列)	-77,040,055.15	-77,040,055.15
本期末	78,942,078.09	78,942,078.09

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	-25,768,694.78	63,231,982.76	37,463,287.98
本期利润	-10,262,521.93	4,841,955.79	-5,420,566.14
本期基金份额交易产生的变动数	13,227,067.89	-23,091,993.52	-9,864,925.63
其中：基金申购款	-2,887,968.28	5,171,504.83	2,283,536.55
基金赎回款	16,115,036.17	-28,263,498.35	-12,148,462.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,804,148.82	44,981,945.03	22,177,796.21

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	活期存款利息收入	21,766.11
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	179.37	
其他	258.21	
合计	22,203.69	

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	卖出股票成交总额	209,658,339.02
减：卖出股票成本总额	218,961,465.67	
买卖股票差价收入	-9,303,126.65	

6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	卖出/赎回基金成交总额	1,798,955.99
减：卖出/赎回基金成本总额	1,844,250.47	
基金投资收益	-45,294.48	

6.4.3.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股指期货投资收益	-

注：无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	913,453.41
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	913,453.41

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	4,841,955.79
——股票投资	4,848,893.51
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-6,937.72
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——股指期货	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	4,841,955.79

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	7,412.17
其他	0.00
转换费	0.00
合计	7,412.17

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%。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	703,223.12
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	703,223.12

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
审计费用	19,890.78	
信息披露费	59,672.34	
证券出借违约金	-	
其他费用	13,617.33	
税务顾问费	17,167.20	
银行汇划费用	1,757.27	
合计	112,104.92	

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

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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股票成交总

		票成交总 额的比例		额的比例
招商香港	-	-	4,579,981.22	3.85%

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 2020年1月1日至2020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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	4,579.97	3.35%	-	-

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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,224,563.17	1,677,156.60
其中：支付销售机构的客户维护费	219,708.40	295,242.43

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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	238,109.47	326,113.78

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。

6.4.6.3 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	5,127,924.37	20,014.82	4,232,082.46	18,293.30
渣打银行	2,908,472.45	2,188.87	20,596,788.52	2,359.09

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。

6.4.6.7 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（2020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

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约责任，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。本基金的活期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 2020 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 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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 2020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	7,388,479.62	-	-	647,917.20	8,036,396.82
结算备付金	223,648.49	-	-	-	223,648.49
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	92,275,893.88	92,275,893.88
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,943,823.22	2,943,823.22
应收利息	-	-	-	571.94	571.94
应收股利	-	-	-	407,642.92	407,642.92
应收申购款	-	-	-	227,701.86	227,701.86
资产总计	7,612,128.11	-	-	96,503,551.02	104,115,679.13
负债					
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	302,137.36	302,137.36
应付赎回款	-	-	-	2,269,945.57	2,269,945.57
应付管理人报酬	-	-	-	146,785.92	146,785.92
应付托管费	-	-	-	28,541.70	28,541.70
应付交易费用	-	-	-	46,540.10	46,540.10
其他负债	-	-	-	201,854.18	201,854.18
负债总计	-	-	-	2,995,804.83	2,995,804.83
利率敏感度缺口	7,612,128.11	-	-	93,507,746.19	101,119,874.30
上年度末 2019年12月31日					
资产					
银行存款	14,047,555.76	-	-	10,905,734.23	24,953,289.99
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	159,846,302.30	159,846,302.30
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	973,118.41	973,118.41
应收利息	-	-	-	1,143.67	1,143.67
应收股利	-	-	-	41,680.30	41,680.30
应收申购款	-	-	-	53,742.99	53,742.99

资产总计	14,047,555.76	-	-	171,821,721.90	185,869,277.66
负债					
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,691,926.99	2,691,926.99
应付赎回款	-	-	-	1,243,048.43	1,243,048.43
应付管理人报酬	-	-	-	276,730.23	276,730.23
应付托管费	-	-	-	53,808.67	53,808.67
应付交易费用	-	-	-	36,523.19	36,523.19
其他负债	-	-	-	160,421.11	160,421.11
负债总计	-	-	-	4,462,458.62	4,462,458.62
利率敏感度缺口	14,047,555.76	-	-	167,359,263.28	181,406,819.04

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 2020 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 2020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				
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	4,564,550.10	67,394,595.19	20,316,748.59	92,275,893.88
买入返售金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	456,174.90	-	456,174.90
应收利息	-	0.94	-	0.94
应收股利	3,284.89	309,902.95	35,276.78	348,464.62
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
银行存款	4,531.02	2,256,271.70	647,917.20	2,908,719.92
资产合计	4,572,366.01	70,416,945.68	20,999,942.57	95,989,254.26
以外币计价的负债				
衍生金融负债	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	302,137.36	302,137.36

应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	302,137.36	302,137.36
资产负债表外汇风险敞口净额	4,572,366.01	70,416,945.68	20,697,805.21	95,687,116.90
项目	上年度末 2019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	5,053,823.26	3,467,980.98	10,905,470.58	19,427,274.82
交易性金融资产	23,296,810.61	106,393,322.39	30,156,169.30	159,846,302.30
应收股利	-	-	41,680.30	41,680.30
应收证券清算款	-	973,118.41	-	973,118.41
应收利息	14.02	1.44	-	15.46
资产合计	28,350,647.89	110,834,423.22	41,103,320.18	180,288,391.29
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	2,691,924.80	2,691,924.80
负债合计	-	-	2,691,924.80	2,691,924.80
资产负债表外汇风险敞口净额	28,350,647.89	110,834,423.22	38,411,395.38	177,596,466.49

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 478	增加约 888
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 478	减少约 888

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和基金，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，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。严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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，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 2020年6月30日		上年度末 2019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	92,275,893.88	91.25	157,995,114.11	87.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	1,851,188.19	1.02
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	92,275,893.88	91.25	159,846,302.30	88.11

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	增加约 487	增加约 961
2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	减少约 487	减少约 961	

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 2020 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 92,275,893.88 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	92,275,893.88	88.63
	其中：普通股	87,711,343.78	84.24
	存托凭证	4,564,550.10	4.38
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
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	8,260,045.31	7.93
8	其他各项资产	3,579,739.94	3.44
9	合计	104,115,679.13	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	67,394,595.19	66.65
日本	18,762,716.31	18.55
美国	4,564,550.10	4.51
韩国	1,554,032.28	1.54
合计	92,275,893.88	91.25

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（%）
非日常生活消费品	30,478,628.63	30.14
电信业务	20,224,144.80	20.00
医疗保健	14,023,014.29	13.87
信息技术	13,283,611.12	13.14
工业	5,050,753.21	4.99
金融	2,659,389.22	2.63
房地产	2,506,479.36	2.48
原材料	2,419,702.56	2.39
日常消费品	1,630,170.69	1.61
合计	92,275,893.88	91.25

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	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港证 券交易 所	中国香港	21,000.00	9,564,264.86	9.46
2	ALIBABA	阿里巴巴	9988 HK	香港证	中国香港	36,000.00	6,892,452.86	6.82

	GROUP HOLDING LTD			券交易所				
			BABA US	纽约证券交易所	美国	1,400.00	2,137,867.41	2.11
3	JD.COM INC - CLASS A	京东集团	9618 HK	香港证券交易所	中国香港	30,000.00	6,352,061.76	6.28
4	SONY CORP	索尼有限公司	6758 JP	东京证券交易所	日本	9,000.00	4,373,336.45	4.32
5	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	碧桂园服务	6098 HK	香港证券交易所	中国香港	119,500.00	3,929,618.88	3.89
6	NINTENDO CO LTD	任天堂	7974 JP	东京证券交易所	日本	1,200.00	3,791,330.50	3.75
7	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育	2020 HK	香港证券交易所	中国香港	60,000.00	3,748,757.76	3.71
8	NETEASE INC	网易	9999 HK	香港证券交易所	中国香港	30,000.00	3,661,067.52	3.62
9	TOKYO ELECTRON LTD	东京电子	8035 JP	东京证券交易所	日本	2,000.00	3,479,927.04	3.44
10	NEXON CO LTD	NEXON 株式会社	3659 JP	东京证券交易所	日本	20,000.00	3,207,481.92	3.17
11	WUXI APPTEC CO LTD-H	药明康德	2359 HK	香港证券交易所	中国香港	30,000.00	2,759,502.24	2.73
12	MEITUAN DIANPING -CLASS B	美团点评	3690 HK	香港证券交易所	中国香港	16,000.00	2,512,325.38	2.48
13	LOGAN GROUP CO LTD	龙光集团	3380 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000.00	2,506,479.36	2.48
14	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药	1177 HK	香港证券交易所	中国香港	160,000.00	2,133,795.84	2.11
15	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	30,000.00	2,123,748.00	2.10
16	ADVANTEST CORP	爱德万测试	6857 JP	东京证券交易所	日本	5,000.00	2,013,724.80	1.99

17	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	福莱特玻 璃	6865 HK	香港证 券交易 所	中国香港	250,000.0 0	1,909,089.60	1.89
18	CHUGAI PHARMA CEUTICAL CO LTD	中外制药	4519 JP	东京证 券交易 所	日本	5,000.00	1,896,915.60	1.88
19	HISENSE HOME APPLIAN CES GR-H	海信家电	921 HK	香港证 券交易 所	中国香港	200,000.0 0	1,644,192.00	1.63
20	WUXI BIOLOGI CS CAYMAN INC	药明生物	2269 HK	香港证 券交易 所	中国香港	12,000.00	1,554,309.50	1.54
21	SAMSUNG ELECTRON ICS CO LTD	三星电子 有限公司	005930 KS	韩国证 券交易 所	韩国	5,000.00	1,554,032.28	1.54
22	PINDUODU O INC- ADR	拼多多	PDD US	纳斯达 克交易 所	美国	2,400.00	1,458,490.27	1.44
23	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	海螺水泥	914 HK	香港证 券交易 所	中国香港	30,000.00	1,430,447.04	1.41
24	SEMICON DUCTOR MANUFACT URING	中芯国际	981 H1	香港证 券交易 所	中国香港	45,000.00	1,109,829.60	1.10
25	MICROPOR T SCIENTIF IC CORP	微创医疗	853 HK	香港证 券交易 所	中国香港	36,000.00	1,025,975.81	1.01
26	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	紫金矿业	2899 HK	香港证 券交易 所	中国香港	300,000.0 0	989,255.52	0.98
27	TAL EDUCATIO N GROUP- ADR	好未来教 育集团	TAL US	纽约证 券交易 所	美国	2,000.00	968,192.42	0.96
28	INNOVENT BIOLOGI CS INC	信达生物	1801 HK	香港证 券交易 所	中国香港	18,000.00	945,410.40	0.93
29	CANSINO BIOLOGI CS INC-H	康希诺	6185 HK	香港证 券交易 所	中国香港	4,500.00	878,820.62	0.87

30	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	香港证 券交易 所	中国香港	24,000.00	790,308.29	0.78
31	KINGDEE INTERNAT IONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	香港证 券交易 所	中国香港	48,000.00	790,089.06	0.78
32	SEMICON DUCTOR MANUFACT URING	中芯国际	981 HK	香港证 券交易 所	中国香港	30,000.00	739,886.40	0.73
33	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIEN CE-H	君实生物	1877 HK	香港证 券交易 所	中国香港	14,000.00	714,218.74	0.71
34	AK MEDICAL HOLDINGS LTD	爱康医疗	1789 HK	香港证 券交易 所	中国香港	30,000.00	675,488.88	0.67
35	YIHAI INTERNAT IONAL HOLDING	颐海国际	1579 HK	香港证 券交易 所	中国香港	9,000.00	653,155.27	0.65
36	BEIJING CHUNLIZH ENGDA MEDI-H	春立医疗	1858 HK	香港证 券交易 所	中国香港	13,000.00	626,985.22	0.62
37	ZHENGZHO U COAL MINING MACH-H	郑煤机	564 HK	香港证 券交易 所	中国香港	186,400.0 0	568,685.82	0.56
38	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 H1	香港证 券交易 所	中国香港	60,000.00	552,448.51	0.55
39	CHINA RESOURCE S BEER HOLDING	华润啤酒	291 HK	香港证 券交易 所	中国香港	14,000.00	552,448.51	0.55
40	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 H2	香港证 券交易 所	中国香港	25,000.00	541,213.20	0.54
41	CITIC SECURITI ES CO LTD-H	中信证券	6030 H1	香港证 券交易 所	中国香港	40,000.00	535,641.22	0.53
42	LIFETECH SCIENTIF IC CORP	先健科技	1302 HK	香港证 券交易 所	中国香港	200,000.0 0	445,758.72	0.44

43	WH GROUP LTD	万洲国际	288 HK	香港证券交易所	中国香港	70,000.00	424,566.91	0.42
44	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	雅迪控股	1585 H2	香港证券交易所	中国香港	80,000.00	390,952.32	0.39
45	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	海吉亚医疗	6078 HK	香港证券交易所	中国香港	15,000.00	365,832.72	0.36
46	WEIMOB INC	微盟集团	2013 H2	香港证券交易所	中国香港	40,000.00	355,510.85	0.35

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	JD.COM INC - CL A	9618 HK	7,206,010.00	3.97
2	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	7,032,812.18	3.88
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	6,682,713.90	3.68
4	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	6,172,910.41	3.40
5	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	5,042,526.31	2.78
6	SONY CORP	6758 JP	4,294,859.49	2.37
7	WUXI APPTec CO LTD-H	2359 HK	4,048,026.05	2.23
8	NINTENDO CO LTD	7974 JP	3,863,948.93	2.13
9	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	3,548,493.04	1.96
10	NETEASE INC	9999 HK	3,519,864.82	1.94
11	NEXON CO LTD	3659 JP	3,186,247.50	1.76
12	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	6862 HK	3,159,722.85	1.74
13	SHENZHOu INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	3,143,988.92	1.73
14	TOKYO ELECTRON LTD	8035 JP	3,122,460.32	1.72
15	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	3,010,130.02	1.66
16	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	2,918,806.16	1.61
17	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	2,557,726.61	1.41
18	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	2,349,037.33	1.29

19	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	3382 JP	2, 191, 773. 14	1. 21
20	EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	1995 HK	2, 159, 736. 74	1. 19
21	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	1, 948, 941. 79	1. 07
22	JD.COM INC-ADR	JD US	1, 041, 468. 49	0. 57
23	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 H1	904, 700. 86	0. 50

注：“买入金额”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	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	16, 344, 076. 60	9. 01
2	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	15, 193, 860. 43	8. 38
3	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	13, 758, 503. 55	7. 58
4	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	10, 353, 787. 39	5. 71
5	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	9, 570, 134. 80	5. 28
6	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	8, 283, 563. 66	4. 57
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	7, 372, 811. 39	4. 06
8	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	6, 704, 662. 35	3. 70
9	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1288 HK	5, 999, 064. 14	3. 31
10	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	6862 HK	5, 973, 579. 38	3. 29
11	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2319 HK	5, 842, 953. 14	3. 22
12	FANUC CORP	6954 JP	5, 118, 408. 32	2. 82
13	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27 HK	4, 492, 611. 08	2. 48
14	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	2502 JP	4, 313, 389. 92	2. 38
15	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	3382 JP	4, 287, 899. 47	2. 36
16	YASKAWA ELECTRIC CORP	6506 JP	4, 250, 036. 49	2. 34
17	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	2777 HK	4, 129, 160. 90	2. 28
18	JD.COM INC-ADR	JD US	4, 121, 766. 85	2. 27
19	FAST RETAILING CO LTD	9983 JP	4, 030, 260. 29	2. 22
20	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	3, 958, 732. 68	2. 18
21	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	3, 163, 215. 69	1. 74
22	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 H1	2, 119, 652. 26	1. 17
23	JD.COM INC - CL A	9618 HK	1, 051, 746. 03	0. 58
24	SUNNY OPTICAL TECH	2382 H1	566, 652. 50	0. 31

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	148, 382, 892. 41
卖出收入（成交）总额	209, 658, 339. 02

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

本基金本报告期末未持有基金投资。

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	2,943,823.22
3	应收股利	407,642.92
4	应收利息	571.94
5	应收申购款	227,701.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,579,739.94

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
5,981	13,198.81	3,146,459.84	3.99%	75,795,618.25	96.01%

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	1,076,423.31	1.36%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§ 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	143,943,531.06
本报告期基金总申购份额	12,038,602.18
减：本报告期基金总赎回份额	77,040,055.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	78,942,078.09

§ 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于2020年1月10日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江

向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

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	
华兴资本	-	98,129,446.83	27.41%	98,129.49	23.71%	-
里昂证券	-	22,426,157.61	6.26%	90,491.82	21.86%	-
Jefferies	-	84,076,514.72	23.48%	83,556.75	20.19%	-
大和证券	-	62,972,378.76	17.59%	64,786.19	15.65%	-
野村证券	-	32,229,005.07	9.00%	38,674.81	9.34%	-
中金公司	-	4,580,253.48	1.28%	15,080.80	3.64%	-
华泰联合	-	8,968,854.23	2.50%	7,178.10	1.73%	-
摩根士坦利	-	33,019,121.80	9.22%	5,375.55	1.30%	-
中银国际	-	3,141,157.90	0.88%	3,141.16	0.76%	-
中信建投	-	3,541,279.10	0.99%	2,838.81	0.69%	-
瑞士信贷	-	3,281,389.84	0.92%	2,625.12	0.63%	-
申银万国	-	1,675,500.88	0.47%	2,010.60	0.49%	-

注：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》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我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；能根据公司业务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。

10.7.2 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	占当期回购成交总额的比例	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
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴资本	-	-	-	-	-	-	-	-
里昂证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Jefferies	-	-	-	-	-	-	-	-
大和证券	-	-	-	-	-	-	1,797,157.06	100.00%
野村证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根士坦利	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷	-	-	-	-	-	-	-	-

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	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29

2	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
4	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的基金经理变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-23
5	博时大中华亚太精选股票证券投资基金更新招募说明书（正文）	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-23
6	博时大中华亚太精选股票证券投资基金更新招募说明书（摘要）	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-23
7	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-22
8	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-17
9	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2019 年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-27
10	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
11	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-17

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 13.1.1 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
- 13.1.2 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金托管协议》
- 13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 13.1.5 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
- 13.1.6 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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

11.3 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
二〇二〇年八月三十一日