

**博时大中华亚太精选股票证券投资基金**  
**2021 年第 1 季度报告**  
**2021 年 3 月 31 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：二〇二一年四月二十二日

## § 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。

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 2021 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 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   |
| 报告期末基金份额总额 | 68,198,351.08 份   |
| 投资目标       | 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。</p> <p>“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。</p> <p>“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。</p> <p>本基金“核心”加“卫星”股票投资比例合计不低于基金资产的 60%。<br/>         本基金主要投资市场包括：香港交易所、新加坡交易所、纽约股票交易所、美国股票交易所及纳斯达克市场。</p> <p>此外，本基金亦可投资于亚太国家或地区的房地产信托凭证等其他权益类证券；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等固定收益类证券；银行存款、短期政府债券等货币市</p> |

|             |   |
|-------------|---|
|             | <p>场工具；基金如 ETFs 等、结构性投资产品、金融衍生产品；以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，本基金对固定收益类证券的投资比例为基金资产的 0-35%，对现金或者到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</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。  |
| 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  |
| 境外资产托管人英文名称 | Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited   |
| 境外资产托管人中文名称 | 渣打银行（香港）有限公司  |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益      | 6,140,165.71                            |
| 2.本期利润         | -1,935,802.31                           |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0285                                 |
| 4.期末基金资产净值     | 103,463,294.39                          |
| 5.期末基金份额净值     | 1.517                                   |

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。

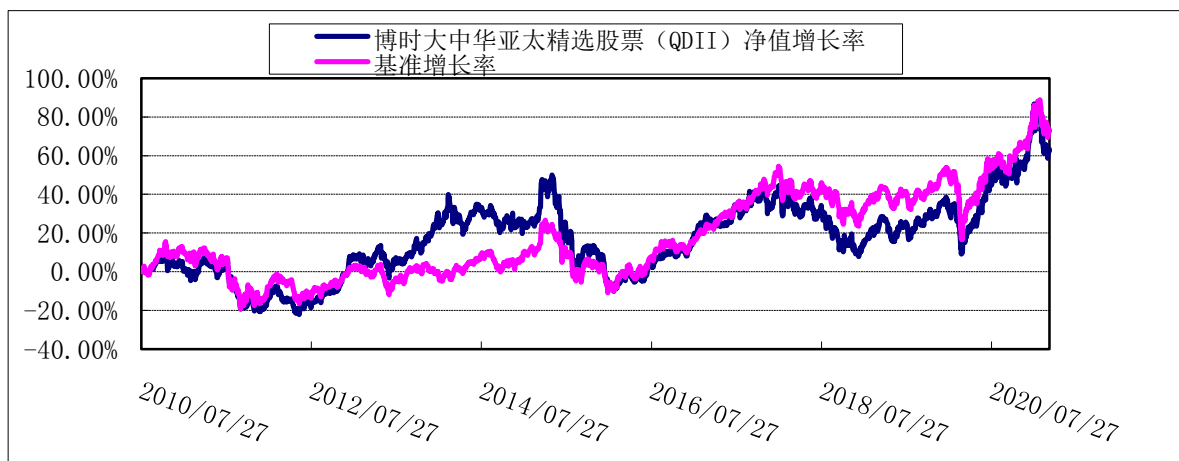
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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             | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|----------------|--------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -1.04% | 1.70%         | 1.65%          | 1.31%             | -2.69% | 0.39% |
| 过去六个月          | 10.33% | 1.64%         | 12.70%         | 1.20%             | -2.37% | 0.44% |
| 过去一年           | 37.41% | 1.53%         | 33.38%         | 1.14%             | 4.03%  | 0.39% |
| 过去三年           | 22.64% | 1.28%         | 23.41%         | 1.04%             | -0.77% | 0.24% |
| 过去五年           | 65.43% | 1.17%         | 72.03%         | 0.94%             | -6.60% | 0.23% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 62.63% | 1.21%         | 72.14%         | 0.99%             | -9.51% | 0.22% |

**3.2.2 自基金合同生效以来 基金累计份额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 基金经理（或基金经理小组）简介**

| 姓名  | 职务              | 任本基金的基金经理期限 |      | 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  | -    | 27.5   | 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、先锋投资合伙公司、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—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—至今)、博时抗通胀增强回报证券投资基金(2020年11月3日—至今)、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金(2021年1月20日—至今)、博时港股通领先趋势混合型证券投资基金(2021年2月9日—至今)的基金经理。 |
| 杨涛  | 基金经理            | 2017-11-29  | -    | 14.7   | 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—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—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、本基金的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 公平交易专项说明

### 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 11 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 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

今年第一季度组合表现整体不理想，春节前和春节后资本市场环境和组合表现迥然不同。年初至二月中市场流动性好，社融活跃，港股 A 股市场反应积极，但随着二月以来美债长端利率上行，央行货币及信用收紧等政策变化，以及中美关系更趋紧张背景下，股市在春节后快速调整，各种原因之外，特别受影响的是估值偏高和机构抱团较重的“核心”企业。市场连续调整六周，到三月底已处于磨底平衡状态，之前的龙头股票普遍回撤了 20-30%。虽然市场有结构性局部反弹，整体短期缺乏方向。大中华基金持有互联网龙头企业较多，易受影响。亚太区投资组合整体表现合理，对基金有正贡献。

在一季度的板块表现中，顺周期板块及估值便宜的板块相对表现较好，包括银行，有色，化工，煤炭，建材，非银等顺周期领域，随着中国经济的持续向上和全球供给短缺，给一季度顺周期板块带来较好的前景和明显的业绩增长。加上国企改革和国家碳中和政策，给很多顺周期领域和企业带

来了长期机遇的可能性。同时，新经济领域在面临美好未来的大环境下，也遇到一些短期的困扰，其中包括 10 月底开始的反垄断监管政策，蚂蚁上市暂停，及其他政策调整出台的影响。互联网龙头企业短期面临政策风险，新能源汽车和光伏发电市场竞争加剧，部分企业债及地方债违约事件等引起市场关注和担忧。但整体来说，21 年我们正处于脱虚入实的政策窗口，政策对实体经济和资本市场的长期支持是持续稳定的，在这个时间点，我们更应该迎合政策的调整 and 方向，帮助和参与到实体经济和企业的成长中去。

#### 市场观点：

一季度市场发生的变化和关注点包括：1) 10 年期美债收益率上升到 1.6-1.75% 之间，比年底上升 50 个基点，速度较快，加上油价及大宗商品普遍上涨，引发市场对全球通胀和美联储下一步货币收紧的情绪担忧，2) 全球各大疫苗的快速推进和接种，导致对疫情修复和海外经济修复的预期有所提升，这也转为对通胀和美联储加息的预期增加了更多压力，3) 中美关系自去年 11 月拜登当选美国总统后处于“停战”或“蜜月”状态，大家普遍认为中美关系在新任政府上台后有修复的可能，但实际上自 1 月底拜登上任后的对华政策，仍然保留了特朗普时期的挟制和对抗，这是外围不利因素。4) 美股在 12 年牛市后存在泡沫，三月底美国对冲基金 Archegos Capital 因流动性问题和自身的高杠杆持仓而爆仓洗盘，促使很多中概股股价短期受影响，充分暴露了市场风险。5) 央行对疫情后经济修复过程中，资本的高杠杆风险和传导性作出新的调整指导，这是相对货币及信用收紧，为长期稳定提前做准备，今年将是关键的政策年。6) 监管部门对违规事件的加强监管也是为搭建长期更合理的经济和金融结构，这包括金融监管，碳中和等，短期来说，给互联网龙头企业增加了不确定性。

一季度的经历提醒我们更关注市场风险和投资标的性价比，今年的市场波幅预计会保持较大，投资策略正在这样的环境下需要做适当调整，择时变得更加重要。我们认为全球经济表现将持续向上，疫苗将推动整体修复，两会对中国经济的 6% 增长定调偏正面。微观层面观察多数依然很正面，上市公司业绩理想，多数增长明显且前景乐观，特别是与出口相关的制造业和上游资源类行业受益较多。与经济正相关的顺周期板块将有明显的业绩提升。宏观层面未知数正在增加，央行信用收紧等调控政策加上美债利率上升对未来流动性增加阻力，另外中美关系的阶段性恶化以及美股潜在风险也给市场情绪增加负担。整体上我们认为估值和性价比变得更加重要，这种市场环境更有利于传统的顺周期板块，但是高质量高成长的新经济行业龙头还是很有吸引力，可以关注抄底机会。二季度我们比较看好的板块包括：银行，地产，券商，保险，建材，建筑，化工，有色，公用事业，电气设备等；长期看好的板块包括：创新消费，连锁餐饮，物业管理，线上教育，电子，生物医药。基于对近期集中报告的业绩分析，我们对基本面没有大的调整变化。

我们对港股市场的判断较春节前的主要变化在于：今年对于估值过高的股票可以短期谨慎。除此之外，对港股市场的主要观点变化不多，在最近一个半月的股市回撤后，多数股票的估值已经做了调整并到了合理估值的区间，多数港股仍然比 A 股便宜，会继续引来估值修复的重估机会。南下资金和国际资金将会持续流入，海外流动性宽裕，IPO 市场活跃，港股市场有机会成为较大的国际流动性受益者。其次从投资标的角度看，港股市场中优质及稀缺的股票标的在过去五年中大幅增

加，覆盖科技，消费，医疗，教育，新能源等各个领域，将成为国内投资者选股和配置的重地。第三，港股新上市公司及二次上市的中概股回归潮将继续，很大程度上增加多元化和提升港股市场吸引力。除此以外，从估值角度看，港股中小成长公司和顺周期的航运，有色，化工，基建，机械，航空等板块仍有明显被低估的迹象。最后国际资本市场趋势容易在香港先落地后再进中国，包括众所皆知的气候变化主题。

对于美股中概股市场，我们短期持偏谨慎的观点。近期美国证监会提出的对外国公司在美股上市的新要求，明确是针对中概股企业并起到打压作用，如果中资企业不能在三年内满足它的条件，将面临摘牌的可能性，这对香港市场特别是港交所是有利的，但是短期看得出对中概股带来很大的不确定性。另外基于目前市场对新冠疫情控制和疫苗发展的预期，海外市场包括亚太，美国，欧洲等资本市场都反应正面，特别是消费及服务板块，也包括高端制造业，是滞后反应的受疫情灾难后的补涨机会，所以今年一季度海外股市表现正面。

#### 投资策略：

大中华亚太精选的投资策略依然是寻找和投资优质价值成长企业为主，用穿越周期的眼光去找长期收益和复合收益。基于上述的市场观点和变化，我们会重点关注几个方向：1) 受全球复苏及中国经济正面影响的亚太企业，2) 中国企业特别是优质制造业的海外发展路径和全球市场机遇，包括中国互联网龙头企业，3) 科技，高端制造，及新医药领域的国产替代和基础设施，4) 国内最有长期竞争力的上游资源有色企业，5) 估值偏低的优质企业。

考虑到目前市场环境，基金将保持中等偏高仓位和谨慎乐观的姿态。虽然市场短期波幅较大，但震荡向上是主要方向。基金在一季度增加了一些顺周期的金融地产标的，相对偏向于基本面稳健向上，下跌风险可控，长期优势明显及可穿越周期的股票。基金在今年将继续保持重要赛道的核心股票投资，适当增加对顺周期板块成长股的投资，以企业价值成长为主要衡量指标。将继续关注核心资产的质量，长期竞争力，ESG，和政策风险，保持稳健风格，密切关注行业及个股动态变化。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 03 月 31 日，本基金的基金份额净值为 1.517 元，份额累计净值为 1.599 元。报告期内，本基金的基金份额净值增长率为-1.04%，同期业绩基准增长率为 1.65%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目   | 金额(人民币元)      | 占基金总资产的比例(%) |
|----|------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资 | 93,210,206.25 | 88.95        |

|   |                       |                |        |
|---|-----------------------|----------------|--------|
|   | 其中：普通股                | 93,210,206.25  | 88.95  |
|   | 存托凭证                  | -              | -      |
|   | 优先股                   | -              | -      |
|   | 房地产信托                 | -              | -      |
| 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<br>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<br>金合计      | 11,180,602.35  | 10.67  |
| 8 | 其他各项资产                | 397,962.01     | 0.38   |
| 9 | 合计                    | 104,788,770.61 | 100.00 |

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家（地区） | 公允价值(人民币元)    | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 中国香港   | 64,553,783.50 | 62.39        |
| 日本     | 18,077,229.60 | 17.47        |
| 韩国     | 8,007,804.86  | 7.74         |
| 中国台湾   | 2,571,388.29  | 2.49         |
| 合计     | 93,210,206.25 | 90.09        |

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 信息技术     | 20,411,103.93 | 19.73        |
| 非日常生活消费品 | 16,127,688.29 | 15.59        |
| 电信业务     | 14,144,050.45 | 13.67        |
| 金融       | 12,266,900.27 | 11.86        |
| 工业       | 8,140,697.70  | 7.87         |
| 医疗保健     | 6,609,969.69  | 6.39         |
| 房地产      | 6,469,134.51  | 6.25         |
| 公用事业     | 3,451,613.69  | 3.34         |
| 原材料      | 3,214,091.92  | 3.11         |
| 日常消费品    | 1,675,146.76  | 1.62         |
| 能源       | 699,809.04    | 0.68         |
| 合计       | 93,210,206.25 | 90.09        |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。



#### 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称<br>(英文)                 | 公司名称<br>(中文) | 证券代码      | 所在证<br>券市场      | 所属<br>国家<br>(地区) | 数量<br>(股)  | 公允价值(人<br>民币元) | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
|----|------------------------------|--------------|-----------|-----------------|------------------|------------|----------------|--------------------------|
| 1  | TENCENT HOLDINGS LTD         | 腾讯控股         | 700 HK    | 香港证<br>券交易<br>所 | 中国<br>香港         | 15,000.00  | 7,733,397.00   | 7.47                     |
| 2  | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD   | 三星电子         | 005930 KS | 韩国证<br>券交易<br>所 | 韩国               | 12,000.00  | 5,671,009.78   | 5.48                     |
| 3  | TOKYO ELECTRON LTD           | 东京电子         | 8035 JP   | 东京证<br>券交易<br>所 | 日本               | 2,000.00   | 5,573,063.32   | 5.39                     |
| 4  | SONY CORP                    | 索尼           | 6758 JP   | 东京证<br>券交易<br>所 | 日本               | 8,000.00   | 5,524,229.04   | 5.34                     |
| 5  | NINTENDO CO LTD              | 任天堂          | 7974 JP   | 东京证<br>券交易<br>所 | 日本               | 1,100.00   | 4,049,136.01   | 3.91                     |
| 6  | CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 建设银行         | 939 HK    | 香港证<br>券交易<br>所 | 中国<br>香港         | 720,000.00 | 3,979,783.58   | 3.85                     |
| 7  | JD.COM INC - CLASS A         | 京东集团         | 9618 HK   | 香港证<br>券交易<br>所 | 中国<br>香港         | 14,000.00  | 3,810,071.44   | 3.68                     |
| 8  | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD     | 安踏体育         | 2020 HK   | 香港证<br>券交易<br>所 | 中国<br>香港         | 32,000.00  | 3,429,402.37   | 3.31                     |
| 9  | MEITUAN DIANPING-CLASS B     | 美团           | 3690 HK   | 香港证<br>券交易<br>所 | 中国<br>香港         | 11,000.00  | 2,772,359.44   | 2.68                     |
| 10 | COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 碧桂园服务        | 6098 HK   | 香港证<br>券交易<br>所 | 中国<br>香港         | 40,000.00  | 2,664,007.36   | 2.57                     |

注：所用证券代码采用当地市场代码。

#### 5.5 报告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。

#### 5.6 报告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。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

### 5.8 报告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。

### 5.9 报告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。

### 5.10 投资组合报告附注

**5.10.1** 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。

**5.10.2** 报告期内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。

#### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(人民币元)   |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | -          |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | 312,701.87 |
| 4  | 应收利息    | 765.94     |
| 5  | 应收申购款   | 84,494.20  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 397,962.01 |

#### 5.10.4 报告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。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |               |
|--------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 66,791,956.99 |
| 报告期基金总申购份额   | 19,738,527.31 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 18,332,133.22 |

|             |               |
|-------------|---------------|
| 报告期基金拆分变动份额 | -             |
| 报告期期末基金份额总额 | 68,198,351.08 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |   |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|---|---------------|------|------|---------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间   | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 2021-01-01~2021-01-24;<br>2021-02-09~2021-02-24;<br>2021-03-09~2021-03-31 | 13,891,687.07 | -    | -    | 13,891,687.07 | 20.37% |

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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 2021 年 3 月 31 日，博时基金公司共管理 259 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 14651 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 4208 亿元人民币，累计分红逾 1426 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。

其他大事件：

2021 年 03 月 27 日，在华夏时报主办的华夏机构投资者年会暨第十四届金蝉奖颁奖盛典中，博时基金荣获年度品牌基金公司奖。

2021 年 03 月 26 日，由广东时代传媒集团举办的“影响力中国时代峰会 2021”在广东广州举办，博时基金荣获《时代周报》第五届时代金融金桔奖“最佳财富管理机构奖”。

2021 年 03 月 18 日，由易趣财经传媒、《金融理财》杂志社主办的 2020 年度第十一届“金貔貅奖”颁奖晚宴暨中国金融创新与发展论坛在北京维景国际大酒店成功召开，博时基金获 2020 年度第十一届金貔貅奖“年度金牌基金公司”。

2021 年 03 月 08 日，在《投资洞见与委托》(Insights & Mandate) 举办的 2021 年度专业投资大奖评选中，博时国际荣获五项年度大奖，包括“最佳机构法人投资经理”、“年度最佳 CEO”、“年度最佳 CIO (固定收益)”三项市场表现大奖，“亚洲年度最佳人民币投资公司”一项区域表现大奖，以及“中国离岸债券基金 (3 年)”一项投资表现大奖。

## § 9 备查文件目录

---

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 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
- 9.1.2 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 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
- 9.1.6 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

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 9.3 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  
二〇二一年四月二十二日