

博时大中华亚太精选股票证券投资基金
2021 年中期报告
2021 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：二〇二一年八月三十一日

§ 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 2021 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 2021 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
1.2 目录	2
§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	8
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	8
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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	27
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	27
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	30
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	32
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	32
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	32
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	32
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	33
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	33
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	34
10.1 基金份额持有人大会决议	34
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	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	34
10.4 基金投资策略的改变	34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	34
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	36
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	37
11.1 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	37
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	37
§ 12 备查文件目录	37
12.1 备查文件目录	37
12.2 存放地点	38
12.3 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	65,609,500.63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%。</p> <p>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。

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5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		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 (2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,003,877.10
本期利润	501,843.80
加权平均基金份额本期利润	0.0074
本期加权平均净值利润率	0.47%
本期基金份额净值增长率	1.44%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	-5,082,727.76
期末可供分配基金份额利润	-0.0775
期末基金资产净值	102,049,130.62
期末基金份额净值	1.555
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	66.70%

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。

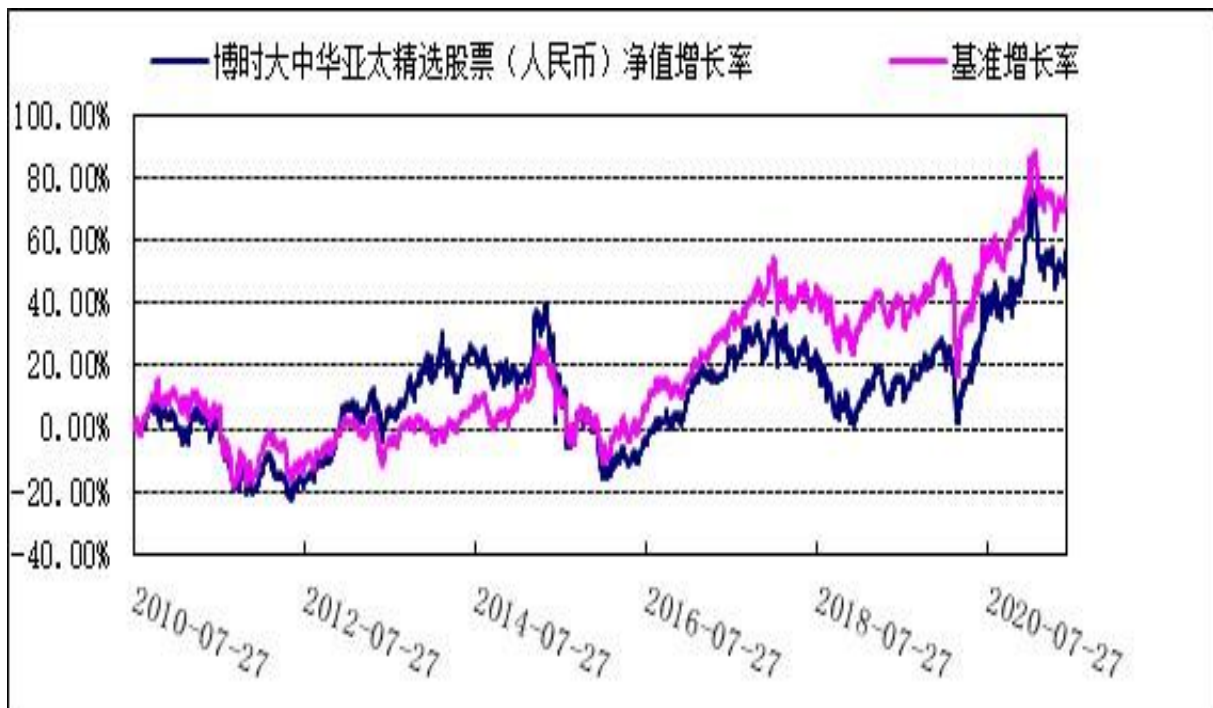
3.2 基金净值表现

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	1.50%	0.85%	1.02%	0.60%	0.48%	0.25%
过去三个月	2.50%	1.02%	0.39%	0.75%	2.11%	0.27%
过去六个月	1.44%	1.40%	1.86%	1.07%	-0.42%	0.33%
过去一年	21.39%	1.48%	17.63%	1.06%	3.76%	0.42%
过去三年	27.25%	1.28%	22.37%	1.07%	4.88%	0.21%
自基金合同生效起至今	66.70%	1.20%	72.81%	1.01%	-6.11%	0.19%

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 2021 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 276 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 15482 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 4383 亿元人民币，累计分红逾 1465 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。

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	-	27.8	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)、博时抗通胀增强回报证券投资基金(2020 年 11 月 3 日一至今)、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 日一至今)、博时港股通领先趋势混合型证券投资基金(2021 年 2 月 9 日一至今)、博时港股通红利精选混合型发起式证券投资基金(2021 年 5 月 27 日一至今)的基金经理。
杨涛	基金经理	2017-11-29	-	14.9	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 公平交易制度和控制方法

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

4.4.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.4.3 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 24 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

上半年港股及亚太地区市场整体表现一般，总收益跟年初差不多，除澳洲外主要市场均远落后于北美及欧洲市场表现。从经济层面看，以美国为首的西方发达国家在疫苗成功推出后信心大幅提升，市场对疫情后经济复苏预期提升，资金逐步流回美国及欧洲市场，另一方面，短期通胀明显，叠加中美关系在拜登政府上台后持续面临挑战，除基本面之外的几个因素都偏负面，导致市场情绪受一定影响。整体上港股上半年机会集中在中小盘个股，及强周期和低估值的个股，表现相对较好，“核心资产”表现不佳，过去两年引领市场的白马龙头股相对表现一般，估值多数处于中高位置。市场对业绩增长的考核更加严格，相应

估值得以调整。

上半年，由于互联网和教育等板块受政策冲击，加上消费相对疲弱，餐饮及相关食品饮料板块表现不佳，影响到股票相应表现及组合业绩。这些负面影响短期还没有完全撤离，板块修复还需要持续观察。整体上我们降低了一些消费，周期，及互联网的仓位，并增加了新能源相关的投资标的。从正面看，港股上市的体育运动品牌商受新疆棉及国产替代的影响，增长明显且对未来信心提升，线上销售强劲，抢占了更多的市场份额和品牌影响力。新能源汽车属于新周期开始阶段，国内海外需求都较强劲，技术路线明确，业务增量明显，在今年下半年将维持高景气度，是布局增持的领域。另一个领域我们持续看好的是港股医疗领域，包括创新药及医疗服务等板块。

过去一年也许是一个时代的结束和另一个时代的开始，我们必须对周围环境和政策保持敏感，重视国家经济发展方向，脱虚入实，展望未来。虽然港股以恒生科技指数为代表的新经济板块今年压力较大，从年内高点（2月17号）到季度末下跌了25.5%，我们对它的未来保持信心。互联网龙头公司股价今年表现不佳，一方面是龙头已经很大且国内用户体量接近上限，找到下一个体量级增长曲线或爆款产品的难度正在加大，另一方面国家正加强对新兴产业（如互联网金融）的监管和政策指导，资本市场对企业盈利的短期担忧也是正常的。我们认为加强监管为行业长期健康发展打下基础，对整个中国经济和社会做更大的贡献做准备。从短期看增加了一些不确定性，但对长期发展是有利的。自新冠疫情发生后，中国科技龙头公司的长期竞争力正加速提升，大有弯道超车的可能性。

市场观点：

展望下半年，我们认为市场将维持成长风格，随着疫苗接种进度的持续推进，对经济复苏和通胀上行的预期边际增强将有可能对市场短期带来冲击。从市场风格来看，成长板块内部进一步分化，有高增速匹配、能达到甚至超预期的企业将可以靠盈利增长继续上涨，而基本面不达预期的公司表现将落后。下半年我们看好新能源及科技成长机会。此外，我们会关注金融及顺周期行业板块，互联网行业的机会。我们也会关注美国及欧洲复苏的具体情况及相应的货币政策变化。下半年，我们认为亚太地区优质成长企业有机会在上半年停滞后退赶上同业。

我们认为通过上半年的估值和性价比调整，市场环境已大致消化成长和估值的差异，虽然有部分公司仍存在被高估或低估的情况或机会，但是整体上港股大市在半年期的调整后，高质量高成长的新经济行业龙头回归合理估值，可以逐渐关注抄底机会。A股市场成长和价值风格差异更大，但整体市场机会很多，企业对未来信心饱满，优质企业越来越多。我们长期看好的板块包括：创新消费，互联网经济，食品饮料，物业管理，电子，生物医药等领域。基于对近期预报的业绩分析，我们对基本面调整不大，对部分行业（如半导体）有提升预期的可能性。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，日益成为国内投资者选股和配置的重地。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，旅游等板块仍有被低估的标的。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年06月30日，本基金基金份额净值为1.555元，份额累计净值为1.637元。报告期内，

本基金基金份额净值增长率为 1.44%，同期业绩基准增长率为 1.86%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们的策略依然是寻找投资优质价值成长型企业，用穿越周期的眼光去找长期收益。基于上述的市场观点，我们会重点关注几个方向：1) 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，但不局限于制造业，2) 高端制造等领域的国产替代机会，3) 有长期竞争力的上游资源企业。

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公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、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合规守信、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 2021 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	6,285,924.39	9,901,860.28
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	94,501,078.96	99,302,869.05
其中：股票投资		94,501,078.96	99,302,869.05
基金投资		-	-
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		2,121,342.88	-
应收利息	6.4.3.5	332.19	842.80
应收股利		279,164.40	7,841.63
应收申购款		153,314.28	271,148.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		103,341,157.10	109,484,562.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		367,208.62	2,155,960.90
应付赎回款		670,268.75	4,634,850.75
应付管理人报酬		148,576.09	155,779.65
应付托管费		28,889.80	30,290.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	16,191.66	4,867.36
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	60,891.56	127,887.49
负债合计		1,292,026.48	7,109,636.65
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	65,609,500.63	66,791,956.99
未分配利润	6.4.3.10	36,439,629.99	35,582,969.06
所有者权益合计		102,049,130.62	102,374,926.05
负债和所有者权益总计		103,341,157.10	109,484,562.70

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.555 元，基金份额总额 65,609,500.63 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		2,569,757.77	-3,142,565.46
1. 利息收入		12,039.66	22,203.69
其中：存款利息收入	6.4.3.11	12,039.66	22,203.69
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）		9,261,352.38	-8,434,967.72
其中：股票投资收益	6.4.3.12	8,249,485.47	-9,303,126.65
基金投资收益	6.4.3.13	2,928.50	-45,294.48
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	1,008,938.41	913,453.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-6,502,033.30	4,841,955.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-227,465.07	420,830.61

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 3. 17	25, 864. 10	7, 412. 17
减：二、费用		2, 067, 913. 97	2, 278, 000. 68
1. 管理人报酬		950, 893. 52	1, 224, 563. 17
2. 托管费		184, 895. 91	238, 109. 47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 3. 18	840, 532. 16	703, 223. 12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		10. 55	-
7. 其他费用	6. 4. 3. 19	91, 581. 83	112, 104. 92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		501, 843. 80	-5, 420, 566. 14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		501, 843. 80	-5, 420, 566. 14

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	66, 791, 956. 99	35, 582, 969. 06	102, 374, 926. 05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	501, 843. 80	501, 843. 80
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）	-1, 182, 456. 36	354, 817. 13	-827, 639. 23
其中：1. 基金申购款	23, 960, 380. 68	15, 276, 899. 23	39, 237, 279. 91
2. 基金赎回款	-25, 142, 837. 04	-14, 922, 082. 10	-40, 064, 919. 14
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）	65, 609, 500. 63	36, 439, 629. 99	102, 049, 130. 62
项目	上年度可比期间 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

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：孙献

会计机构负责人：佘方方

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 2021年6月30日
活期存款	6,285,924.39
定期存款	-
其他存款	-
合计	6,285,924.39

注：于 2021 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 165,178.81 元(折合人民币 1,067,071.63 元)，港元 791,382.99(折合人民币 658,493.95 元)，日元 8,969,097.00(折合人民币 524,046.40 元)，新台币 105,237.56 元(折合人民币 24,390.81 元)，新加坡元 56.76 元(折合人民币 272.74 元)，澳元 7.69 元(折合人民币 37.29 元)，韩元 1637.00 元(折合人民币 9.39 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 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	80,993,739.38	94,501,078.96	13,507,339.58
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	80,993,739.38	94,501,078.96	13,507,339.58

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	332.19
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	332.19

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 2021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	16,191.66
合计	16,191.66

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,384.19
应付证券出借违约金	-
预提费用	59,507.37
合计	60,891.56

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	66,791,956.99	66,791,956.99
本期申购	23,960,380.68	23,960,380.68
本期赎回(以“-”号填列)	-25,142,837.04	-25,142,837.04
本期末	65,609,500.63	65,609,500.63

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	-11,934,385.96	47,517,355.02	35,582,969.06
本期利润	7,003,877.10	-6,502,033.30	501,843.80
本期基金份额交易产生的变动数	-152,218.90	507,036.03	354,817.13
其中：基金申购款	-3,097,598.68	18,374,497.91	15,276,899.23
基金赎回款	2,945,379.78	-17,867,461.88	-14,922,082.10
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-5,082,727.76	41,522,357.75	36,439,629.99
-----	---------------	---------------	---------------

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入	11,660.73	
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	277.30	
其他	101.63	
合计	12,039.66	

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额	230,609,218.11	
减：卖出股票成本总额	222,359,732.64	
买卖股票差价收入	8,249,485.47	

6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出/赎回基金成交总额	733,851.86	
减：卖出/赎回基金成本总额	730,923.36	
基金投资收益	2,928.50	

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资产生的股利收益	1,008,938.41	
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	1,008,938.41	

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
1. 交易性金融资产	-6,502,033.30	
——股票投资	-6,502,033.30	
——债券投资	-	
——资产支持证券投资	-	
——基金投资	-	

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
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	-6,502,033.30

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	25,861.72
转换费	2.38
合计	25,864.10

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 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	840,532.16
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	840,532.16

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
其他费用	13,752.25
税务顾问费	16,948.87
银行汇划费用	1,373.34
合计	91,581.83

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券(香港)	2,677,976.06	0.59%	-	-

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 2021年1月1日至2021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
招商证券(香港)	2,677.98	0.64%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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
招商证券(香港)	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	950,893.52	1,224,563.17
其中：支付销售机构的客户维护费	172,178.19	219,708.40

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.8\% / \text{当年天数。}$$

6.4.6.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	184,895.91	238,109.47

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数。}$$

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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日	2020年1月1日至2020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	4,011,600.60	12,039.66	5,127,924.37	20,014.82
渣打银行	2,274,323.79	-	2,908,472.45	2,188.87

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（2021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及绩效分析工作，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，将风险控制可在承受的范围之内。

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同责任，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 2021 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 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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 2021 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	5,737,167.73	-	-	548,756.66	6,285,924.39
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	94,501,078.96	94,501,078.96
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,121,342.88	2,121,342.88
应收利息	-	-	-	332.19	332.19
应收股利	-	-	-	279,164.40	279,164.40
应收申购款	-	-	-	153,314.28	153,314.28
资产总计	5,737,167.73	-	-	97,603,989.37	103,341,157.10
负债					
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	367,208.62	367,208.62

应付赎回款	-	-	-	670,268.75	670,268.75
应付管理人报酬	-	-	-	148,576.09	148,576.09
应付托管费	-	-	-	28,889.80	28,889.80
应付交易费用	-	-	-	16,191.66	16,191.66
其他负债	-	-	-	60,891.56	60,891.56
负债总计	-	-	-	1,292,026.48	1,292,026.48
利率敏感度缺口	5,737,167.73	-	-	96,311,962.89	102,049,130.62
上年度末 2020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	9,492,631.11	-	-	409,229.17	9,901,860.28
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	99,302,869.05	99,302,869.05
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	842.80	842.80
应收股利	-	-	-	7,841.63	7,841.63
应收申购款	-	-	-	271,148.94	271,148.94
资产总计	9,492,631.11	-	-	99,991,931.59	109,484,562.70
负债					
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,155,960.90	2,155,960.90
应付赎回款	-	-	-	4,634,850.75	4,634,850.75
应付管理人报酬	-	-	-	155,779.65	155,779.65
应付托管费	-	-	-	30,290.50	30,290.50
应付交易费用	-	-	-	4,867.36	4,867.36
其他负债	-	-	-	127,887.49	127,887.49
负债总计	-	-	-	7,109,636.65	7,109,636.65
利率敏感度缺口	9,492,631.11	-	-	92,882,294.94	102,374,926.05

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 2021 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 2021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				
银行存款	1,067,071.63	658,493.95	548,756.66	2,274,322.24
交易性金融资产	-	65,132,809.34	29,368,269.62	94,501,078.96
应收证券清算款	-	-	2,121,342.88	2,121,342.88
应收利息	3.23	0.27	-	3.50
应收股利	-	54,398.14	102,863.06	157,261.20
资产合计	1,067,074.86	65,845,701.70	32,141,232.22	99,054,008.78
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	367,208.62	-	367,208.62
负债合计	-	367,208.62	-	367,208.62
资产负债表外汇风险敞口净额	1,067,074.86	65,478,493.08	32,141,232.22	98,686,800.16
项目	上年度末 2020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	11,300.48	3,086,890.14	409,221.00	3,507,411.62
交易性金融资产	-	66,804,080.86	32,498,788.19	99,302,869.05
应收股利	-	-	7,841.63	7,841.63
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	385.75	1.87	-	387.62
资产合计	11,686.23	69,890,972.87	32,915,850.82	102,818,509.92
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	1,912,828.53	243,132.37	2,155,960.90
负债合计	-	1,912,828.53	243,132.37	2,155,960.90
资产负债表外汇风险敞口净额	11,686.23	67,978,144.34	32,672,718.45	100,662,549.02

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 493	增加约 503
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 493	减少约 503

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	94,501,078.96	92.60	99,302,869.05	97.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	94,501,078.96	92.60	99,302,869.05	97.00

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 681	增加约 571
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 681	减少约 571	

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) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 94,501,078.96 元，属于第二层次的余额为 0.00 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 99,302,869.05 元，第二层次 0.00 元，第三层次 0.00 元）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	94,501,078.96	91.45
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	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	6,285,924.39	6.08
8	其他各项资产	2,554,153.75	2.47
9	合计	103,341,157.10	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	65,132,809.34	63.82
日本	15,221,604.13	14.92
韩国	9,041,719.39	8.86
中国台湾	5,104,946.10	5.00
合计	94,501,078.96	92.60

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（%）
信息技术	24,020,886.36	23.54
非日常生活消费品	18,825,133.32	18.45
医疗保健	15,998,235.74	15.68
电信业务	14,770,556.06	14.47
工业	7,741,921.94	7.59
原材料	6,226,931.67	6.10
金融	3,276,398.21	3.21
房地产	2,058,066.67	2.02
能源	886,498.03	0.87
日常消费品	696,450.96	0.68
合计	94,501,078.96	92.60

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	中国香 港证券 交易所	中国香港	16,000.00	7,774,955.52	7.62
2	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	安踏体育	2020 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	38,000.00	5,779,960.51	5.66
3	TOKYO ELECTRON	东京电子	8035 JP	日本证 券交易	日本	2,050.00	5,758,897.39	5.64

	LTD			所				
4	WUXI APPTTEC CO LTD-H	药明康德	2359 HK	中国香港 证券交易 交易所	中国香港	38,000.00	5,732,531.95	5.62
5	SONY GROUP CORP	索尼有限 公司	6758 JP	日本证 券交易 所	日本	9,000.00	5,687,089.38	5.57
6	LG CHEM LTD	LG 化学有 限公司	051910 KS	韩国证 券交易 所	韩国	1,000.00	4,875,633.75	4.78
7	SAMSUNG ELECTRON ICS CO LTD	三星电子	005930 KS	韩国证 券交易 所	韩国	9,000.00	4,166,085.64	4.08
8	NINTENDO CO LTD	任天堂	7974 JP	日本证 券交易 所	日本	1,000.00	3,775,617.36	3.70
9	JD. COM INC - CL A	京东集团	9618 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	14,000.00	3,557,641.25	3.49
10	WUXI BIOLOGIC S CAYMAN INC	药明生物	2269 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	28,000.00	3,315,339.55	3.25
11	NETEASE INC	网易	9999 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	22,000.00	3,219,983.18	3.16
12	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学 科技	2382 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	15,000.00	3,062,886.48	3.00
13	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	碧桂园服 务	6098 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	42,000.00	2,932,083.50	2.87
14	MEDIATEK INC	MEDIATEK INC	2454 TT	台湾证 券交易 所	中国台湾	13,000.00	2,898,504.31	2.84
15	CANSINO BIOLOGIC S INC-H	康希诺生 物	6185 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	7,500.00	2,574,871.56	2.52
16	NEWBORN TOWN INC	赤子城科 技	9911 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	450,000.00	2,546,164.80	2.50
17	TAIWAN SEMICON DUCTOR MANUFAC	台积电	2330 TT	台湾证 券交易 所	中国台湾	16,000.00	2,206,441.79	2.16
18	HONG KONG EXCHANGE S & CLEAR	香港交易 所	388 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	4,500.00	1,732,889.81	1.70

19	TECHTRON IC INDUSTRI ES CO LTD	创科实业	669 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	15,000.00	1,692,450.72	1.66
20	SHANGHAI FOSUN PHARMACE UTI-H	复星医药	2196 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	30,000.00	1,565,142.48	1.53
21	CHINA MERCHANT S BANK-H	招商银行	3968 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	28,000.00	1,543,508.40	1.51
22	INNOVENT BIOLOGIC S INC	信达生物	1801 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	18,000.00	1,356,207.19	1.33
23	BYD CO LTD-H	比亚迪股 份	1211 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	7,000.00	1,352,462.83	1.33
24	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	赣锋锂业	1772 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	14,000.00	1,351,297.92	1.32
25	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	福莱特玻 璃	6865 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	50,000.00	1,331,328.00	1.30
26	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	信义光能	968 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	90,000.00	1,255,109.47	1.23
27	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	金科服务	9666 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	20,000.00	1,212,340.56	1.19
28	Q TECHNOLO GY GROUP CO LTD	丘钛科技	1478 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	90,000.00	1,192,204.22	1.17
29	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华	1088 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	70,000.00	886,498.03	0.87
30	EXCELLEN CE COMMERCIAL PROPER	卓越商企 服务	6989 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	120,000.00	845,726.11	0.83
31	L. K. TECHNOLO GY HOLDINGS LTD	力劲科技	558 HK	中国香 港证券 交易所	中国香港	60,000.00	807,783.26	0.79
32	CIFI EVER	旭辉永升	1995 HK	中国香	中国香港	50,000.00	802,125.12	0.79

	SUNSHINE SERVICES	服务		港证券交易所				
33	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	中芯国际	981 HK	中国香港证券交易所	中国香港	40,000.00	795,468.48	0.78
34	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	868 HK	中国香港证券交易所	中国香港	30,000.00	790,059.96	0.77
35	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药	460 HK	中国香港证券交易所	中国香港	280,000.00	773,501.57	0.76
36	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	中国联塑	2128 HK	中国香港证券交易所	中国香港	45,000.00	717,419.38	0.70
37	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	华润啤酒	291 HK	中国香港证券交易所	中国香港	12,000.00	696,450.96	0.68
38	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	中国香港证券交易所	中国香港	40,000.00	680,641.44	0.67
39	HAIER SMART HOME CO LTD-H	海尔智家	6690 HK	中国香港证券交易所	中国香港	28,000.00	631,382.30	0.62
40	PERFECT MEDICAL HEALTH MANAG	完美医疗	1830 HK	中国香港证券交易所	中国香港	80,000.00	624,392.83	0.61

注：所用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	JD.COM INC - CL A	9618 HK	6,478,164.64	6.33
2	KUAISHOU TECHNOLOGY	1024 HK	5,184,743.80	5.06
3	NEWBORN TOWN INC	9911 HK	5,004,486.62	4.89
4	ADVANTEST CORP	6857 JP	4,615,262.88	4.51
5	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	4,584,328.37	4.48
6	CHINA CONSTRUCTION	939 HK	4,409,171.56	4.31

	BANK-H			
7	INPEX CORP	1605 JP	4,278,886.31	4.18
8	MEITUAN-CLASS B	3690 HK	4,258,987.09	4.16
9	NETEASE INC	9999 HK	4,182,137.21	4.09
10	WUXI APPTTEC CO LTD-H	2359 HK	4,136,480.92	4.04
11	NEXON CO LTD	3659 JP	4,117,689.39	4.02
12	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	3,878,540.93	3.79
13	LG CHEM LTD	051910 KS	3,497,840.68	3.42
14	SOFTBANK GROUP CORP	9984 JP	3,445,895.78	3.37
15	TOKYO ELECTRON LTD	8035 JP	3,433,841.08	3.35
16	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	3,126,516.05	3.05
17	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	3,051,325.73	2.98
18	BYD CO LTD-H	1211 HK	2,987,460.14	2.92
19	MEDIATEK INC	2454 TT	2,880,285.54	2.81
20	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	2,685,180.30	2.62
21	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	6865 HK	2,659,112.84	2.60
22	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	2,488,128.91	2.43
23	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	2,482,393.73	2.42
24	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	2020 HK	2,479,675.84	2.42
25	PANASONIC CORP	6752 JP	2,477,971.24	2.42
26	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	1772 HK	2,406,107.40	2.35
27	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930 KS	2,379,850.33	2.32
28	NCSOFT CORP	036570 KS	2,343,166.22	2.29
29	SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	6969 HK	2,282,803.49	2.23
30	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	2,258,981.04	2.21
31	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	2,258,863.80	2.21
32	SONY GROUP CORP	6758 JP	2,198,545.10	2.15
33	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	2,168,821.48	2.12
34	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	2502 JP	2,152,979.14	2.10

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	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	9,329,845.00	9.11
2	MEITUAN-CLASS B	3690 HK	8,278,157.36	8.09
3	JD.COM INC - CL A	9618 HK	7,090,076.69	6.93
4	NEXON CO LTD	3659 JP	6,114,524.28	5.97
5	NETEASE INC	9999 HK	5,474,791.24	5.35
6	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	5,139,036.24	5.02
7	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	5,123,528.90	5.00

8	KUAI SHOU TECHNOLOGY	1024 HK	4,934,187.36	4.82
9	ADVANTEST CORP	6857 JP	4,549,616.94	4.44
10	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	4,430,719.20	4.33
11	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930 KS	4,318,375.73	4.22
12	INPEX CORP	1605 JP	4,093,683.61	4.00
13	LG CHEM LTD	051910 KS	3,600,815.03	3.52
14	TOKYO ELECTRON LTD	8035 JP	3,560,349.01	3.48
15	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	3,558,462.82	3.48
16	NINTENDO CO LTD	7974 JP	3,554,593.76	3.47
17	NEWBORN TOWN INC	9911 HK	3,185,539.55	3.11
18	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	6865 HK	3,119,677.01	3.05
19	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2357 HK	3,044,719.37	2.97
20	SOFTBANK GROUP CORP	9984 JP	2,992,584.26	2.92
21	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	2,735,459.24	2.67
22	BYD CO LTD-H	1211 HK	2,576,290.25	2.52
23	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	2899 HK	2,516,545.51	2.46
24	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	2,468,949.82	2.41
25	NCSOFT CORP	036570 KS	2,410,463.16	2.35
26	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	2,286,085.09	2.23
27	WUXI APTEC CO LTD-H	2359 HK	2,281,880.21	2.23
28	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	2,258,843.26	2.21
29	PANASONIC CORP	6752 JP	2,246,252.52	2.19
30	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	968 HK	2,136,253.50	2.09
31	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	2502 JP	2,121,612.82	2.07

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	224,059,975.85
卖出收入（成交）总额	230,609,218.11

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 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。

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	2,121,342.88
3	应收股利	279,164.40
4	应收利息	332.19
5	应收申购款	153,314.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,554,153.75

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 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。

§ 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
5,679	11,553.00	29,242,870.85	44.57%	36,366,629.78	55.43%

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	237,956.79	0.36%

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

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 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
本报告期初基金份额总额	66,791,956.99
本报告期基金总申购份额	23,960,380.68
减：本报告期基金总赎回份额	25,142,837.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	65,609,500.63

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金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：基金管理人于 2021 年 2 月 6 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》，高阳先生担任公司总经理职务。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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	
大和证券	-	86,043,461.77	18.92%	109,168.24	26.04%	-
里昂证券	-	78,308,421.72	17.22%	88,422.17	21.09%	-
摩根士坦利	-	70,212,958.72	15.44%	36,605.00	8.73%	-
高盛	-	54,344,689.34	11.95%	27,265.64	6.50%	-
农银国际	-	51,365,203.62	11.30%	41,482.16	9.89%	-
中银国际	-	25,142,138.93	5.53%	25,142.15	6.00%	-
Jefferies	-	24,993,499.39	5.50%	24,993.53	5.96%	-
野村证券	-	19,727,068.87	4.34%	23,763.55	5.67%	-
华泰证券	-	14,154,928.21	3.11%	11,324.30	2.70%	-
中金公司	-	13,577,339.37	2.99%	10,861.88	2.59%	-
元富证券	-	7,147,818.10	1.57%	10,006.83	2.39%	-
华兴资本	-	3,484,092.02	0.77%	4,028.63	0.96%	-
海通证券	-	3,316,718.72	0.73%	3,316.72	0.79%	-
招商证券(香港)	-	2,677,976.06	0.59%	2,677.98	0.64%	-
华泰金控(香港)	-	172,879.20	0.04%	172.88	0.04%	-

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，本公司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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所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	成交金额	占当期回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额的比例

		的比例		的比例		的比例		
华兴资本							544,528.25	37.17%
农银国际							487,500.76	33.28%
野村证券							246,438.97	16.82%
高盛	-	-	-	-	-	-	186,395.11	12.72%

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直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
2	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
3	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道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站	2021-04-28
4	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道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站	2021-04-24
5	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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
6	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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
7	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2020 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站	2021-03-31
8	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站	2021-03-30
9	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道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站	2021-03-20
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210310	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
12	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站	2021-02-06
13	博时大中华亚太精选股票证券投资基金 2020 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站	2021-01-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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; 2021-02-09~2021-02-24; 2021-03-09~2021-06-30	13,891,687.07	-	-	13,891,687.07	21.17%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证券监督管理委员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
- 12.1.2 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时大中华亚太精选股票证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 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
- 12.1.6 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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，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
二〇二一年八月三十一日