

博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资 基金

2015 年第 3 季度报告

2015 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年十月二十六日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 10 月 23 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 2015 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时中证淘金大数据 100	
基金主代码	001242	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 4 日	
报告期末基金份额总额	2,501,060,564.92 份	
投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 6%，实现对中证淘金大数据 100 指数的有效跟踪。	
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证淘金大数据 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。	
业绩比较基准	95%×中证淘金大数据 100 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时中证淘金大数据 100 A	博时中证淘金大数据 100 B
下属分级基金的交易代码	001242	001243
报告期末下属分级基金的份额总额	2,029,683,280.98 份	471,377,283.94 份

§ 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 (2015 年 7 月 1 日-2015 年 9 月 30 日)	
	博时中证淘金大数据 100 A	博时中证淘金大数据 100 B
1. 本期已实现收益	-993,309,491.30	-219,371,202.26
2. 本期利润	-880,124,729.09	-195,294,866.29
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.3861	-0.3839
4. 期末基金资产净值	1,232,587,479.80	286,316,687.04
5. 期末基金份额净值	0.6073	0.6074

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

1、博时中证淘金大数据 100 A:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-35.21%	4.52%	-29.38%	4.32%	-5.83%	0.20%

2、博时中证淘金大数据 100 B:

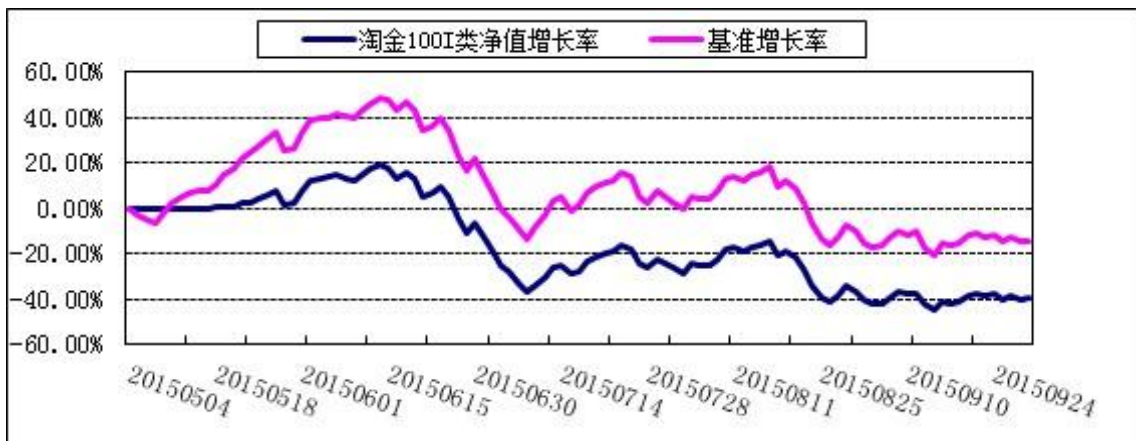
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-35.20%	4.52%	-29.38%	4.32%	-5.82%	0.20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

1. 博时中证淘金大数据 100 A:



2. 博时中证淘金大数据 100 B:



注：本基金合同于 2015 年 5 月 4 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“（二）投资范围”、“（四）投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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		
桂征辉	基金经理	2015-07-21	-	5	2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理。现任博时沪深 300 指数基金兼博时中证淘金大数据 100 指数基金的基金经理。
赵云阳	基金经理	2015-05-04	-	5	2003 年至 2010 年在晨星中国研究中心工作。2010 年加入博时基金管理有限公司，历任量化分析师、基金经理助理、博时特许价值股票基金基金经理。现任博时深证基本面 200ETF 基金兼博时深证基本面 200ETF 联接基金、上证企债 30ETF 基金、博时招财一号保本基金、博时中证淘金大数据 100 基金、博时沪深 300 指数基金、博时证券保险指数分级基金基金经理

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

6 月中旬开始，市场大幅下跌，市场总体出现大幅的下跌市场行情，在短短不到三个月时间里，上证综指从 6 月 12 日最高点 5166，下探到 8 月 26 日最低 2850，下跌幅度达到 44.83%，因此，在这样的极端行情下，所有的股票指数型基金和大多数股票型基金都遭遇了大幅下跌，而淘金大数据 100 作为指数基金，也无法独善其身。在市场大幅下跌的过程中，股票市场伴随着出现了大面积停牌现象，且持续时间较长。因此，在这一阶段基金的仓位操作完全按照指数策略正常进行存在较大的困难，指数所涉及的大部分股票无法交易。我们在相对极端情况下积极操作，保持流动性，保证了基金的正常运作。

本基金为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求组合成份股紧密跟踪指数，利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因，并在最小化交易成本的同时适时调仓，尽可能地减少跟踪误差。同时，在本报告期，我们严格按照基金合同要求，在年中指数权重及成份股变动时，尽量降低成本、减少市场冲击，逐步调整组合与目标指数的结构一致。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 9 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.6073 元，份额累计净值为 0.6073 元；I 类基金份额净值为 0.6074 元，份额累计净值为 0.6074 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-35.21%，I 类基金份额净值增长率为-35.20%，同期业绩基准增长率-29.38%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年 4 季度，从宏观经济角度来看，经济继续处在寻底阶段，但预期企稳的时间继续后延。经济的低迷，市场给予流动性继续宽松的预期仍在，货币政策和财政政策继续给予宽松支持。但受到前期市场下跌给予投资者心理的冲击，从赚钱效应到亏钱套牢的快速转变，市场投资者的风险偏好在降低，股市资产的流出，债券的热捧及场内货币规模的暴涨等现象给予验证。市场投资者空仓观望的氛围较浓，参与短期市场主题的行为会增多，导致市场的波动会逐步加剧。总之，当前市场的运行方向较不明朗，投资者应该多看少动，等待未来市场放量的企稳。

在投资策略上，我们将继续按照指数编制方案，根据电商大数据反映的不同行业景气程度，精选有成长性和合理估值的股票。同时，在投资管理上，我们将继续精心操作，保持较低的跟踪误差。

4.7 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,431,662,200.34	93.69
	其中：股票	1,431,662,200.34	93.69
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	93,406,924.35	6.11
7	其他各项资产	3,000,090.16	0.20
8	合计	1,528,069,214.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	63,645,210.26	4.19
C	制造业	865,836,790.15	57.00

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,100,555.60	3.50
E	建筑业	55,911,673.70	3.68
F	批发和零售业	72,745,769.66	4.79
G	交通运输、仓储和邮政业	51,236,766.82	3.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,113,763.68	4.62
J	金融业	13,580,328.00	0.89
K	房地产业	84,615,265.15	5.57
L	租赁和商务服务业	15,392,343.60	1.01
M	科学研究和技术服务业	12,858,626.40	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	29,422,154.70	1.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	43,202,952.62	2.84
S	综合	-	-
	合计	1,431,662,200.34	94.26

5.3 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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300310	宜通世纪	1,037,812	22,167,664.32	1.46
2	000023	深天地 A	961,200	20,463,948.00	1.35
3	002102	冠福股份	2,309,400	19,883,934.00	1.31
4	002555	顺荣三七	521,800	18,894,378.00	1.24
5	600136	道博股份	561,314	18,484,070.02	1.22
6	300207	欣旺达	692,842	17,307,193.16	1.14
7	600418	江淮汽车	1,274,561	16,926,170.08	1.11
8	002373	千方科技	494,396	16,764,968.36	1.10
9	300137	先河环保	1,000,330	16,615,481.30	1.09
10	002292	奥飞动漫	561,800	16,438,268.00	1.08

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,775,098.45
2	应收证券清算款	473,163.78
3	应收股利	-
4	应收利息	21,278.68
5	应收申购款	730,549.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,000,090.16

5.11.4 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可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300310	宜通世纪	22,167,664.32	1.46	停牌股票
2	000023	深天地A	20,463,948.00	1.35	停牌股票
3	002102	冠福股份	19,883,934.00	1.31	停牌股票

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时中证淘金大数据 100 A	博时中证淘金大数据100 B
本报告期期初基金份额总额	2,902,501,132.97	622,912,322.43
报告期基金总申购份额	336,559,752.64	216,376,378.71
减:报告期基金总赎回份额	1,209,377,604.63	367,911,417.20

报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2,029,683,280.98	471,377,283.94

§ 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

单位：份

项目	博时中证淘金大数据100 A	博时中证淘金大数据100 B
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	0.00
本报告期买入/申购总份额	14,436,904.42	0.00
本报告期卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	14,436,904.42	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.71	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	申购	2015-07-13	14,436,904.42	10,000,000.00	1.00%
合计			14,436,904.42	10,000,000.00	

§ 8 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 2015 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理七十一只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户。博时基金资产管理净值总规模逾 3010.43 亿元人民币，其中公募基金资产规模逾 1,427.53 亿元人民币，累计分红超过 670.72 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，指数股票型基金中，截至 9 月 30 日，博时裕富沪深 300 基金及博时深证基本面 200ETF 今年以来净值增长率在 172 只标准型股票基金中分别排名前 1/2；混合基金-偏股型基金中，博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合 (LOF)、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在 360 只混合偏股基金中排名前 1/2；混合基金-灵活配置型基金中，博时灵活配置混合基金今年以来收益率在 103 只同类基金中排名前 1/2。

固定收益方面，博时安丰 18 个月定期开放债券 LOF 今年以来在 15 只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金 A 类中，博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类 68 只排名前 1/10，博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前 1/3，博时信用债纯债 A、博时安心收益定期开放债券 A 以及博时优势收益信用债债券基金排名前 1/2；在长期标准债券基金 B/C 类中，博时安心收益定期开放债券 C 类今年以来收益率在同类 47 只中排名前 1/3；普通债券型基金中，博时稳定价值债券 A 类和 B 类在同类 88 只一级 A 类和 51 只一级 B 类中，今年以来收益率都排名前 1/5；可转债基金中，博时转债增强 A 今年以来收益率在同类 15 只排名前 1/2；指数债券型中，博时上证企债 30ETF 在同类 18 只中排名前 1/3；货币市场基金里，博时现金宝货币 A 类在同类 150 只中排名前 1/2。

2、其他大事件

2015 年 8 月 3 日，博时基金经理过钧和张溪冈，荣获证券时报颁发的英华奖；同时，过钧获得证券时报评选的三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理，张溪冈获得证券时报评选的三年期海外投资-最佳基金经理。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金设立的文件

9.1.2 《博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金基金合同》

9.1.3 《博时中证淘金大数据 100 指数型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 报告期内博时中证淘金大数据 100 指数型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
二〇一五年十月二十六日