

博时中证银联智惠大数据 100 指数型证  
券投资基金

2016 年第 3 季度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年十月二十四日

## § 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 2016 年 10 月 21 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	博时银智大数据 100
基金主代码	002588
交易代码	002588
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 20 日
报告期末基金份额总额	39,763,123.79 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%，实现对中证银联智惠大数据 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，按照成份股在中证银联智惠大数据 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%×中证银联智惠大数据 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	中国工商银行股份有限公司

### § 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
	(2016 年 7 月 1 日-2016 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	3,558,432.18
2. 本期利润	2,498,744.37
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0645
4. 期末基金资产净值	45,814,107.00
5. 期末基金份额净值	1.1522

注：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。

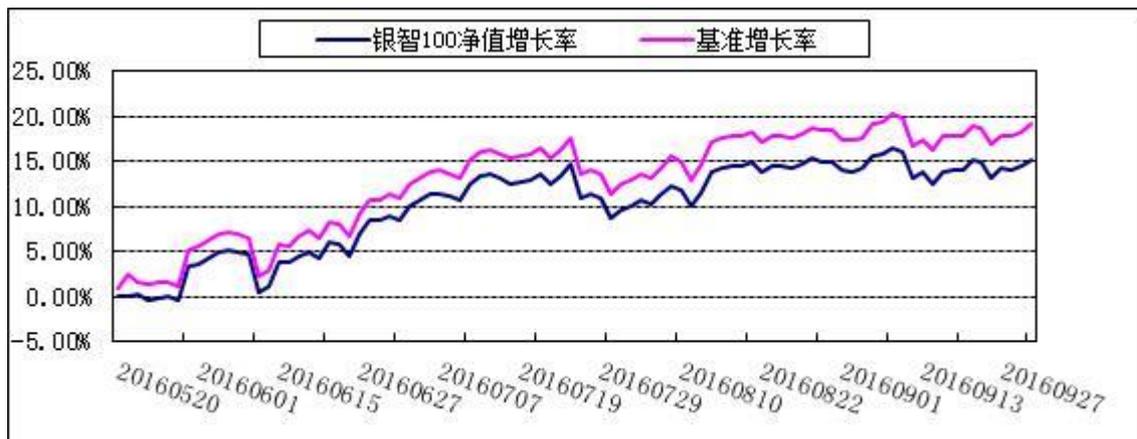
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	5.74%	0.93%	6.97%	0.96%	-1.23%	-0.03%

##### 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



注：本基金合同于 2016 年 5 月 20 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效日起 6 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。

### § 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	2016-05-20	-	7.1	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、博时银智大数据 100 指数基金的基金经理。

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 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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

#### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

在本报告期内，A 股市场整体维持震荡格局，本基金作为指数基金，为保证对于业绩基准的紧密跟踪，我们本着勤勉尽责的态度，严格按照基金合同要求，在月度指数成份股变动时，尽量降低交易成本、减少市场冲击，力求组合成份股紧密跟踪指数，并在最小化交易成本的同时适时调仓，取得了较低的跟踪误差和正的跟踪偏离。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.1522 元，累计份额净值为 1.1522 元，报告期内净值增长率为 5.74%，同期业绩基准涨幅为 4.62%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在本报告期内，分别于 2016 年 7 月 1 日至 2016 年 8 月 1 日、2016 年 8 月 4 日至 2016 年 9 月 30 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

## § 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	42,673,582.75	91.65
	其中：股票	42,673,582.75	91.65
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	3,523,167.54	7.57
7	其他各项资产	364,233.95	0.78
8	合计	46,560,984.24	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	351,709.00	0.77
B	采矿业	368,388.00	0.80
C	制造业	17,422,381.80	38.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,434,124.97	7.50
E	建筑业	682,684.00	1.49
F	批发和零售业	4,154,396.98	9.07
G	交通运输、仓储和邮政业	2,420,223.00	5.28
H	住宿和餐饮业	527,790.00	1.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,731,177.00	8.14
J	金融业	2,343,445.00	5.12
K	房地产业	4,393,887.00	9.59
L	租赁和商务服务业	1,182,118.00	2.58
M	科学研究和技术服务业	466,128.00	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	374,920.00	0.82
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	820,210.00	1.79
S	综合	-	-
	合计	42,673,582.75	93.15

### 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	000055	方大集团	36,500	561,005.00	1.22
2	600644	乐山电力	59,701	535,517.97	1.17
3	300324	旋极信息	24,600	533,820.00	1.17
4	300194	福安药业	22,600	528,162.00	1.15
5	600258	首旅酒店	21,900	527,790.00	1.15
6	002133	广宇集团	68,400	526,680.00	1.15
7	002684	猛狮科技	18,000	525,960.00	1.15
8	000632	三木集团	59,300	524,805.00	1.15
9	600708	光明地产	53,200	524,020.00	1.14
10	000892	星美联合	37,200	523,776.00	1.14

### 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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,376.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	731.88
5	应收申购款	346,125.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	364,233.95

#### 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处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

本报告期期初基金份额总额	36,445,587.50
报告期基金总申购份额	20,836,645.62
减：报告期基金总赎回份额	17,519,109.33
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	39,763,123.79

## § 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	25.15

### 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

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 2016 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 138 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，管理资产总规模约为 5,359.54 亿元人民币，其中公募基金规模约 2,912.48 亿元人民币，累计分红约 738.04 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，2016 年三季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至 9 月 30 日，权益类方面，标准指数股票型基金中，博时中证淘金大数据 100 指数基金、博时中证银行指数分级，今年以来净值增长率在同类型 316 只基金中排名前 10；偏股型基金里，博时行业轮动基金、博时主题行业混合基金，今年以来净值增长率在同类 372 只基金中排名前 20；灵活配置型基金中，博时灵活配置混合 A，今年以来净值增长率在同类排名前 1/10；保本型基金中，博时招财一号大数据保本混合，今年以来净值增长率在同类排名前 1/4；绝对收益目标基金中，博时新财富混合基金今年以来净值增长率为 5.36%，在同类 165 只基金中排名前 1/7。

黄金基金中，博时黄金 ETF (D 类) 今年以来净值增长率为 28.42%，在同类 8 只基金中排名第一。

固定收益方面，标准债券型基金中，博时双月薪定期支付债券、博时月月薪定期支付债券，今年以来净值增长率分别为 6.91%、5.23%，在同类型 61 只基金中分别第二和第五，博时信用债纯债排名前 1/9；普通债券型基金里，稳健回报债券 (LOF) 今年以来净值增长率在同类排名前 1/4；货币市场基金里，博时外服货币，今年以来净值增长率在同类 194 只排名第五；封闭式标准债券基金中，博时安丰 18 个月定开债今年以来净值增长率在同类排名前 1/4。

QDII 基金方面，博时亚洲票息，今年以来至 9 月 30 日净值增长 9.98%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名前 1/2。

### 2、其他大事件

•2016 年 8 月 5 日，由 21 世纪经济报道主办的“2016 深港通论坛暨 ‘金帆奖’ 系列颁奖礼上，博时一举斩获 2016 年综合实力十强基金公司奖、2016 年互联网突出表现奖、2016 年 ABS 最具实力管理人奖 (博时资本) 三项大奖。

## § 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中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金设立的文件

9.1.2 《博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金基金合同》

9.1.3 《博时中证银联智惠大数据 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

二〇一六年十月二十四日