

# 博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资 基金

## 2017 年第 3 季度报告

### 2017 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：二〇一七年十月二十七日

## §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 2017 年 10 月 26 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 2017 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	1,647,678,524.34 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 I
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	1,369,305,781.31 份	278,372,743.03 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 (2017 年 7 月 1 日-2017 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 I
1.本期已实现收益	89,748,545.05	18,171,930.23
2.本期利润	112,823,698.70	22,873,847.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0785	0.0785
4.期末基金资产净值	1,333,215,077.19	271,116,106.96
5.期末基金份额净值	0.9736	0.9739

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:

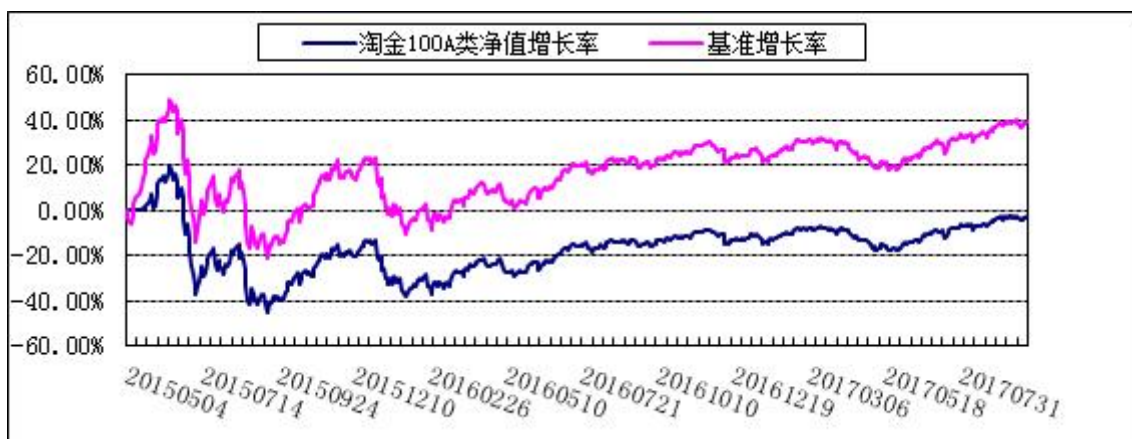
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三 个月	8.67%	0.92%	8.82%	0.92%	-0.15%	0.00%

##### 2. 博时中证淘金大数据 100 I:

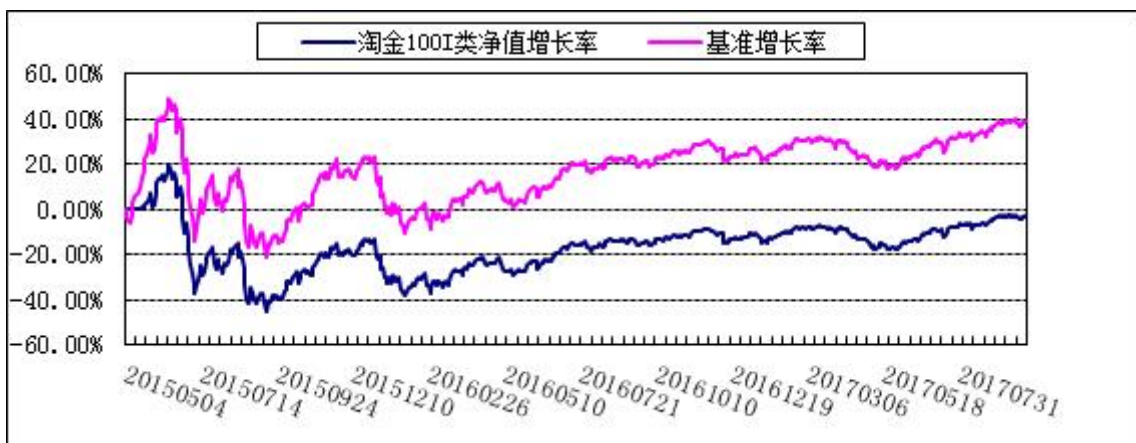
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三 个月	8.67%	0.92%	8.82%	0.92%	-0.15%	0.00%

#### 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 I:



## §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	-	8.1	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、博时中证500指数增强基金的基金经理。

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遵规守信情况的说明

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。

### 4.3 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

2017 年第三季度，A 股市场震荡上行。七月底短暂回撤后市场快速反弹，一路上行到 3390 点，之后市场震荡盘整，调整到 3340 点左右。风格方面，市场从上半年的集中大盘逐渐向中盘转移，但大小盘风格切换尚未完成。行业方面有色、钢铁、煤炭等周期性行业迎来机会，纺织服装、传媒、电力等行业表现落后。本基金在密切跟踪指数的前提下，利用量化手段采取适当的优化操作，在控制跟踪误差的情况下，相对指数获得了一定的超额收益。

展望四季度，考虑到前三季度国内 GDP 增长超预期，再叠加环保限产等因素，预期四季度国内经济增长环比会有一定幅度的下滑。通胀方面，我们预期在 PPI 相对高位持续一段时间的作用下，国内 CPI 存在一定回升的压力；货币政策方面，虽然三季度末央行有针对性降准的动作，但在整体金融防风险的大背景下，我们预计货币政策仍然难以转向，未来一段时间仍然维持中性偏紧态势；汇率方面，在经历前期人民币相对美元快速升值后，预期未来人民币会在目前汇率水平上将会更多地表现出双向的波动。四季度 A 股市预计会出现波动提升的较大可能，主要体现在不同时间的维度；预期会前及会中市场指数会表现相对平稳，会后市场的波动可能加剧。行业方面，重点关注大消费、金融、医药等行业，注意捕捉市场的结构性行情。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9736 元，份额累计净值为 0.9736 元，本基金 I 类基金份额净值为 0.9739 元，份额累计净值为 0.9739 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 8.67%，本基金 I 类基金份额净值增长率为 8.67%，同期业绩基准增长率 8.82%

### 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(元)	占基金总资产的比例(%)
----	----	-------	--------------

1	权益投资	1,514,503,609.55	93.59
	其中：股票	1,514,503,609.55	93.59
2	固定收益投资	291,490.00	0.02
	其中：债券	291,490.00	0.02
	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	101,095,648.29	6.25
7	其他各项资产	2,289,476.31	0.14
8	合计	1,618,180,224.15	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	17,332,131.88	1.08
B	采矿业	61,795,507.60	3.85
C	制造业	881,767,429.01	54.96
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	56,785,527.00	3.54
E	建筑业	48,252,632.00	3.01
F	批发和零售业	144,065,275.17	8.98
G	交通运输、仓储和邮 政业	16,026,320.66	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	56,872,950.83	3.54
J	金融业	26,389,943.00	1.64
K	房地产业	120,287,125.58	7.50
L	租赁和商务服务业	60,763,735.33	3.79
M	科学研究和技术服务 业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	24,049,731.50	1.50
S	综合	-	-
	合计	1,514,503,609.55	94.40

**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	002008	大族激光	425,600	18,556,160.00	1.16
2	000830	鲁西化工	1,658,677	18,444,488.24	1.15
3	600862	中航高科	1,442,800	18,280,276.00	1.14
4	002078	太阳纸业	1,802,100	18,021,000.00	1.12
5	600801	华新水泥	1,231,400	17,769,102.00	1.11
6	600859	王府井	994,600	17,703,880.00	1.10
7	600585	海螺水泥	702,900	17,551,413.00	1.09
8	002365	永安药业	434,500	17,419,105.00	1.09
9	300511	雪榕生物	627,067	17,332,131.88	1.08
10	600308	华泰股份	2,279,362	17,209,183.10	1.07

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	291,490.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	291,490.00	0.02

**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**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	132012	17 巨化 EB	2,830	291,490.00	0.02

**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	369,627.33
2	应收证券清算款	181,068.79
3	应收股利	-
4	应收利息	21,678.60
5	应收申购款	1,717,101.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,289,476.31

#### 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的情况。

#### 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

项目	博时中证淘金大数据 100 A	博时中证淘金大数据 100 I
本报告期期初基金份额总	1,541,324,776.50	308,078,819.83



额		
报告期基金总申购份额	90,216,825.40	31,079,028.73
减：报告期基金总赎回份 额	262,235,820.59	60,785,105.53
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总 额	1,369,305,781.31	278,372,743.03

## §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 I
报告期期初管理人持有的 本基金份额	14,436,904.42	-
报告期期间买入/申购总份 额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份 额	14,436,904.42	-
报告期期末管理人持有的 本基金份额	-	-
报告期期末持有的本基金 份额占基金总份额比例 (%)	-	-

### 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	赎回	2017-07- 05	14,436,904.42	13,131,808.26	-
合计			14,436,904.42	13,131,808.26	

## §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

无。

### 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 2017 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 195 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，管理资产总规模逾 7023.71 亿元人民币，其中公募基金规模逾 4222.25 亿元人民币，累计

分红逾 822.37 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，截至 2017 年 3 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时上证自然资源 ETF 今年以来净值增长率为 25.80%，在同类 104 只基金中排名前 8；博时深证基本面 200ETF、博时上证 50ETF 等今年以来净值增长率排名前 1/8；博时裕富沪深 300 指数(A 类)今年以来净值增长率排名前 1/5；股票型分级子基金里，博时中证银行指数分级 B 今年以来净值增长率为 37.18%，在同类 126 只基金中排名前 1/5；混合偏股型基金中，博时主题行业今年以来净值增长率为 19.97%，在同类基金排名位居前 1/4；混合灵活配置型基金中，博时外延增长、博时产业新动力基金今年以来净值增长率分别为 23.27%、22.17%，在同类基金中排名约位于前 1/8。

黄金基金类，博时黄金 ETF(D 类)今年以来净值增长率 5.76%，在同类排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债(A 类)、博时裕昂纯债债券基金今年以来净值增长率在同类 174 只排名前 1/10；转债基金方面，博时转债增强债券(A 类)今年以来收益率 6.57%，同类排名第四；货币市场基金里，博时外服货币今年以来净值增长率在 631 只同类基金中排名前 1/4。

QDII 基金方面，博时大中华亚太精选股票基金(QDII)、博时大中华亚太精选股票基金(QDII)(美元)，今年以来净值增长率分别为 22.75%、28.34%，同类排名均位于前 1/4。

### 2、其他大事件

2017 年 9 月 24 日，由南方财经全媒体集团和 21 世纪传媒举办的 21 世纪国际财经峰会在深圳举行，博时基金荣获“2017 年度基金管理公司金帆奖”。

2017 年 8 月 6 日，首届济安五星基金“群星汇”暨颁奖典礼在京举行，在基金公司综合奖方面，博时基金获得“群星奖”；在基金公司单项奖方面，博时基金获得“纯债型基金管理奖”、“一级债基金管理奖”、“二级债基金管理奖”三大奖项；在基金产品单项奖方面，博时信用债券 A/B(050011)获得“二级债基金”奖，博时裕富沪深 300 指数 A(050002)获“指数型基金”奖；在本次五星基金明星经理奖的颁奖环节，由于博时外服货币、博时双月薪定期支付债券以及博时信用债券 A/B 在 2017 年第二季度持续获得济安金信五星评级，三只基金的基金经理魏桢、过钧及陈凯杨更是因此获得“五星基金明星奖”的荣誉称号。

## §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 博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 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  
二〇一七年十月二十七日