

博时中证800证券保险指数分级证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
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声明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、完整性和及时性承担法律责任。

基金托管人中国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。

本基金合同自2015年7月1日起至2030年7月1日止。

§ 2 基金产品概况

| 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 | - | - | - |
| C 制造业 | - | - | - |
| D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - | - |
| E 建筑业 | - | - | - |
| F 批发和零售业 | - | - | - |
| G 交通运输、仓储和邮政业 | - | - | - |
| H 住宿和餐饮业 | - | - | - |
| I 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - | - |
| J 金融、房地产 | 257,937,366.40 | 77.41 | |
| K 房地产业 | - | - | - |
| L 租赁和商务服务业 | - | - | - |
| 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 | - | - | - |
| R 文化、体育和娱乐业 | - | - | - |
| S 综合 | - | - | - |
| 合计 | 257,937,366.40 | 77.41 | |

本基金主要投资于股票型基金，跟踪指数为基本指数的目标，力求基金净值增长率与原基准指数比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

投资目标 本基金通过投资于代表未来表现、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。

本基金的运作周期为2015年7月1日起至2030年7月1日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数据(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|------|------------------|---------------|
| 1 | 6001318 | 中国人寿 | 1,700,000 | 50,788,874.00 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 1,739,420 | 23,567,003.60 |
| 3 | 600937 | 海通证券 | 1,795,423 | 22,764,143.25 |
| 4 | 601603 | 中国人保 | 230,300 | 16,382,877.00 |
| 5 | 601628 | 中国人寿 | 440,200 | 11,238,300.00 |
| 6 | 601699 | 华夏保险 | 724,926 | 10,090,997.76 |
| 7 | 600643 | 中国人保 | 729,400 | 9,506,004.00 |
| 8 | 600776 | 广发证券 | 663,000 | 8,564,300.00 |
| 9 | 600916 | 申万宏源 | 983,050 | 8,434,560.00 |
| 10 | 601666 | 中国人保 | 613,600 | 8,223,000.00 |
| 合计 | | | 2,057,937,366.40 | 77.41 |

5.2.3未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.2.4未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

5.2.5未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

5.2.6未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

5.2.7未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

5.2.8未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资明细

5.2.9未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组合

5.2.10未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.11未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.12未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.13未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.14未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组合

5.2.15未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.16未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.17未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.18未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.19未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组合

5.2.20未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.21未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.22未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.23未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.24未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组合

5.2.25未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.26未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.27未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.28未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.29未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组合

5.2.30未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.31未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.32未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.33未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.34未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组合

5.2.35未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.36未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.37未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.38未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.39未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组合

5.2.40未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.41未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.42未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.43未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.44未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组合

5.2.45未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.46未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.47未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.48未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.49未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组合

5.2.50未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.51未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.52未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.53未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.54未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组合

5.2.55未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.56未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.57未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.58未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.59未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组合

5.2.60未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.61未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.62未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.63未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.64未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组合

5.2.65未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.66未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.67未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.68未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.69未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组合

5.2.70未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.71未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.72未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.73未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.74未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组合

5.2.75未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.76未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.77未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.78未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.79未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组合

5.2.80未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.81未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.82未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.83未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.84未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组合

5.2.85未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.86未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.87未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.88未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.89未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组合

5.2.90未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.91未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合

5.2.92未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

5.2.93未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名衍生品投资组合

5.2.94未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组合

5.2.95未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

5.2.96未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资组合