

## 博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金

## [2015] 第四季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不承担虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，于2016年1月10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，复核结果表明不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的托管人承诺以诚实信用、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。

本报告附录财务数据未经审计。

本报告附录财务数据未经审计。

报告期为2015年10月1日至2015年12月31日。

§ 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		5,223,200.00	0.27
B 采矿业		54,820,134.34	2.82
C 制造业		1,156,568,466.72	66.69
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		79,276,961.20	4.08
E 建筑业		64,092,500.00	3.30
F 批发和零售业		110,569,274.00	5.70
G 交通运输、仓储和邮政业		37,375,116.00	1.93
H 住宿和餐饮业		9,199,100.00	0.47
I 信息传输、软件和信息技术服务业		68,091,438.00	2.99
J 金融业		14,443,200.00	0.74
K 房地产业		67,396,332.48	3.47
L 租赁和商务服务业		13,747,276.00	0.71
M 科学研究和技术服务业		11,231,300.56	0.58
N 水利、环境和公共设施管理业		74,904,727.23	3.86
O 国际服务、修理和其他服务业		—	—
P 教育		—	—
R 文化、体育和娱乐业		62,349,761.04	2.69
S 综合		—	—
合计		1,811,378,873.06	93.32

本基金采取量化方式投资策略，通过严格的内部流程约束和数据化风险管理手段，力争在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±0.5%，年度跟踪误差不超过4%，实现对本基金的大数据100指数的有效跟踪。

投资目标 本基金通过量化分析，精选股票，在严格控制风险的前提下获取超额收益。

投资策略 本基金主要采用量化分析方法，根据量化选股模型，构建股票池，进行择股操作。

业绩比较基准 95%×中证淘金大数据100指数+5%×银行存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险与收益水平高于混合型基金，低于货币基金。本基金的预期收益和风险水平高于中证淘金大数据100指数的平均水平。

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

报告期末下属分级基金的基金总资产 1,068,958,687.77元

400,689,080.14元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 (2015年10月1日-2015年12月31日)

博时中证淘金大数据100 A 103,496,765.64

111,667,241.63

2.本期利润 401,136,639.71

111,667,241.63

3.本期平均基金份额利润率 0.2510

0.2568

4.期末基金资产净值 1,598,152,018.76

342,719,094.66

5.期末基金份额净值 0.8651

0.8653

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未实现收益。

所持基金头寸不包括持有人认购交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所列示。

3.2本期平均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: -0.13%

-0.13% 3.2本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其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:

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去三个月 40.80% 2.17% 2.04% -0.10% 0.13%

2.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去六个月 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

3.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去九个月 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

4.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去一年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

5.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去三年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

6.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去五年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

7.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去十年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

8.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去十五年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

9.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去二十年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

10.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去三十年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

11.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去五十年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

12.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去一百年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

13.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去二百年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

14.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去五百年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

15.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去一千年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

16.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去二千年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

17.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去三千年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

18.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去四千年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

19.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去五千年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

20.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去六千年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

21.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去七千年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

22.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去八千年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

23.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去九千年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

24.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去一万年 40.81% 2.17% 40.93% -0.07% 0.13%

25.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去一万五千年的净值增长率为-0.13%。

26.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去一万五千年的净值增长率为-0.13%。

27.博时中证淘金大数据100 A: -0.13%

阶段 净值增长① 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④

过去一万五千年的净值增长率为-0.13%。