博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6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:二〇一九年七月十八日

§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2019年7月17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2019年4月1日起至6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	1,363,814,403.20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	1,152,244,053.90份		211,570,349.30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(2019年4月1日-2019年6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	14,530,772.93	2,553,987.67
2.本期利润	-52,693,102.07	-9,461,247.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0454	-0.0443
4.期末基金资产净值	968,236,178.12	177,836,936.15
5.期末基金份额净值	0.8403	0.8406

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:

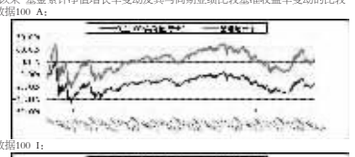
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.25%	1.65%	-5.87%	1.68%	0.62%	-0.03%

2. 博时中证淘金大数据100 I:

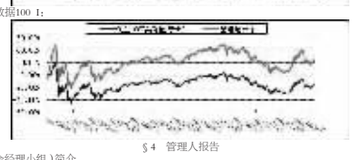
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.24%	1.66%	-5.87%	1.68%	0.63%	-0.02%

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		
杨振建	基金经理	2018-12-03	-	5.8	杨振建先生,博士,2013年至2015年在中证指数有限公司工作(期间曾调中国证监会任产品审核员),2015年加入博时基金管理有限公司,历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理,现任博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金(2018年12月3日一至今),博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金(2018年12月3日一至今)的基金经理。
柱征辉	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2015-07-21	-	9.9	柱征辉先生,硕士,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,现任指数与量化投资部投资副总监兼博时裕富沪深300指数证券投资基金(2015年7月21日一至今),博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金(2016年5月20日一至今)、博时中证500指数增强型证券投资基金(2017年9月26日一至今),博时富时中国A股指数证券投资基金(2018年6月12日一至今)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,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

2019年二季度,A股市场出现明显回调,之后进入震荡期,最终收于2980点左右。风格方面,下跌中,小盘及创业板跌幅更大,大盘相对抗跌,反转效应明显。行业方面食品饮料、家电、银行等行业大幅跑赢市场,传媒及综合行业表现落后。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。

展望2019年三季度,我国经济下行的压力依旧存在,短期内中美贸易摩擦有所缓和,但中长期风险仍在。虽然外部环境的压力可能对出口构成压力,制造业投资也难以显著改善,但是预计减税降费和财政政策的积极有望再下半年支撑消费、制造业投资并明显提振基建投资。货币方面,内外部环境对货币条件边际松动的掣肘在下半年会趋于减弱,转向逆周期调节的概率在增大。当前A股市场风险偏好仍有提升的空间,但应密切关注政策走向及贸易战情况。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年06月30日,本基金A类基金份额净值为0.8403元,份额累计净值为0.8406元,本基金I类基金份额净值为0.8406元,份额累计净值为0.8406元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为-5.25%,本基金I类基金份额净值增长率为-5.24%,同期业绩基准增长率-5.87%。

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	1,082,690,801.43	94.07
	其中:股票	1,082,690,801.43	94.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	67,907,126.61	5.90
8	其他各项资产	380,877.54	0.03
9	合计	1,150,978,805.58	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	31,846,285.16	2.78
B	采矿业	363,431.25	0.03
C	制造业	560,755,576.39	48.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,927,340.00	0.87
E	建筑业	20,194,762.00	1.76
F	批发和零售业	90,083,684.14	7.86
G	交通运输、仓储和邮政业	40,212,343.17	3.51
H	住宿和餐饮业	9,746,865.00	0.85
I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,770,035.58	8.18
J	金融业	43,884,877.94	3.83
K	房地产业	69,247,383.00	6.04
L	租赁和商务服务业	52,632,971.20	4.59
M	科学研究和技术服务业	10,642,212.00	0.93
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	14,086,170.00	1.23
R	文化、体育和娱乐业	35,296,864.60	3.08
S	综合	-	-
	合计	1,082,690,801.43	94.47

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	002010	传化智联	4,388,000	33,041,640.00	2.88
2	002555	三七互娱	1,336,300	18,106,865.00	1.58
3	601900	南方传媒	1,646,788	15,644,486.00	1.37
4	300347	泰格医药	182,700	14,086,170.00	1.23
5	600129	太极集团	1,310,600	13,800,618.00	1.20
6	603444	吉比特	58,700	12,324,652.00	1.08
7	300014	亿纬锂能	400,500	12,199,230.00	1.06
8	002458	益生股份	603,800	11,780,138.00	1.03
9	300296	利亚德	1,503,828	11,774,973.24	1.03
10	603160	汇顶科技	84,000	11,659,200.00	1.02

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 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除华泰股份(600308)外,没有出现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、处罚的情形。

2018年11月27日,因存在违反了《上市公司信息披露管理办法》规定的情形,中国证券监督管理委员会山东监管局对山东华泰纸业股份有限公司给予出具警示函的处分。

对该证券投资决策程序的说明:根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。

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	201,314.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,988.67
5	应收申购款	164,574.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	380,877.54

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额	1,194,328,591.28	221,994,011.50
报告期基金总申购份额	28,065,818.97	11,318,550.38
减:报告期基金总赎回份额	70,150,356.35	21,742,212.58
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,152,244,053.90	211,570,349.30

§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

基金管理人未持有本基金份额。

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

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2019年6月30日,博时基金公司共管理185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9345亿元人民币,剔除货币基金与短期理财债券基金后,博时基金公募资产管理总规模逾2699亿元人民币,累计分红逾980亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,截至2019年2季末:

博时旗下权益类基金业绩亮眼,54只产品(各类份额分开计算,不含QDII,下同)今年来净值增长率银河同类排名在前1/2,31只银河同类排名在前1/4,15只银河同类排名在前1/10,15只银河同类排名在前10。其中,博时但恨灵活配置混合、博时乐臻定期开放混合、博时医疗保健行业混合今年来净值增长率分别在145只、61只、14只同类产品中排名第1;博时量化平衡混合、博时弘泰定期开放混合、博时上证50ETF联接(A类)、博时上证50ETF联接(C类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C类)今年来净值增长率分别在102只、61只、46只、34只、15只同类产品中排名第3;博时特许价值混合(A类)今年来净值增长率在414只同类产品中排名第20;博时鑫源灵活配置混合(C类)、博时鑫源灵活配置混合(A类)、博时上证50ETF、博时新起点灵活配置混合(A类)、博时颐泰混合(C类)、博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前1/10;博时颐泰混合(A类)、博时新兴消费主题混合、博时鑫瑞灵活配置混合(C类)、博时新起点灵活配置混合(C类)、博时鑫泽灵活配置混合(C类)、博时文体娱乐主题混合、博时新兴成长混合、博时鑫瑞灵活配置混合(A类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A类)、博时创新驱动灵活配置混合(C类)、博时鑫泽灵活配置混合(A类)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C类)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前1/4。

博时固定收益类基金业绩表现稳健,58只产品(各类份额分开计算,不含QDII,下同)今年来净值增长率银河同类排名前1/2,29只银河同类排名在前1/4,16只银河同类排名在前1/10,10只银河同类排名在前10,债券型基金中,博时转债增强债券(A类)、博时转债增强债券(C类)今年来净值增长率分别在58只、15只同类产品中排名第1,且分别在全市场参与业绩排名的1928只债券基金中排名第3、第4;博时安盈债券(A类)、博时安盈债券(C类)今年来净值增长率分别在同类产品中排第2、第3;博时安弘一年定期开放债券(A类)、博时安康18个月定期开放债券(LOF)、博时安心收益定期开放债券(A类)、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今年来净值增长率分别在239只同类产品中排名第3、第7、第14、第18、第23;博时裕泰纯债债券、博时裕顺纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时富祥纯债债券、博时裕鹏纯债债券今年来净值增长率分别在352只同类产品中排名第6、第11、第12、第26、第28;博时安弘一年定期开放债券(C类)今年来净值增长率在58只同类产品中排名第3;博时信用债券(A/B类)、博时信用债券(C类)今年来净值增长率在228只、163只同类产品中均排名第11;博时富兴纯债3个月定期开放债券发起式、博时裕瑞纯债债券、博时裕鹏纯债债券、博时双月薪定期支付债券、博时安心收益定期开放债券(C类)、博时裕盛纯债债券、博时裕益纯债3个月定期开放债券发起式、博时裕安纯债债券、博时安丰18个月定期开放债券(A类-LOF)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前1/4,货币型基金中,博时合惠货币(B类)今年来净值增长率在296只同类产品中排名第8,博时合惠货币(A类)、博时现金宝货币(B类)、博时现金宝货币(A类)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前1/4。

商品型基金当中,博时黄金ETF今年来净值增长率同类排名第3。

QDII基金方面,博时标普500ETF今年来净值增长率同类排名第2、博时亚洲票息收益债券、博时亚洲票息收益债券(美元)今年来净值增长率均在同类排名第7。

2、其他大事件

2019年6月20日,由中国基金报独家主办的第六届中国基金业"英华奖"评选隆重揭晓,博时基金在此次英华奖中揽获6项最佳基金经理大奖。其中,博时基金蔡滨拿下"三年期股票投资最佳基金经理";陈凯杨荣膺"五年期纯债投资最佳基金经理";何凯则一举揽获"三年期海外固收投资最佳基金经理"和"五年期海外固收投资最佳基金经理"两项桂冠;过钧则再度获得"三年期二级债投资最佳基金经理"和"五年期二级债投资最佳基金经理"称号。

2019年4月25日,由上海证券报主办的第十六届"金基金"奖的评选结果如期揭晓,博时基金在评选中一举夺得最具份量的公募奖项"2018年度金基金·TOP公司奖",博时主题行业(160505)继去年获得"三年期金基金分红奖"后拿下"2018年度金基金·十年期偏股混合型基金奖",同时,博时裕瑞纯债债券(001578)获得"2018年度金基金·一年期债券基金奖"。

2019年4月14日,第十六届中国基金业金牛奖评选结果揭晓,博时基金旗下债优产品博时主题行业混合(LOF)(160505)荣获"五年期开放式混合型持续优胜金牛基金"奖;博时信用债纯债债券(050027)荣获"三年期开放式债券型持续优胜金牛基金"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主题行业混合型证券投资基金(LOF)设立的文件

9.1.2《博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

9.1.3《博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)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博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时中证银联智惠大数据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
二〇一九年七月十八日

博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6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:二〇一九年七月十八日

§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2019年7月17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2019年4月1日起至6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
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	31,874,970.31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
下属分级基金的基金简称	博时银智大数据100A	博时银智大数据100C
下属分级基金的交易代码	002588	004416
报告期末下属分级基金的份额总额	31,282,231.03份	592,739.28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(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	博时银智大数据100A	博时银智大数据100C
1.本期已实现收益	2,721,726.27	52,716.64
2.本期利润	-497,724.18	-12,196.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0151	-0.0188
4.期末基金资产净值	40,255,562.60	754,350.01
5.期末基金份额净值	1.2869	1.2727

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. 博时银智大数据100A:

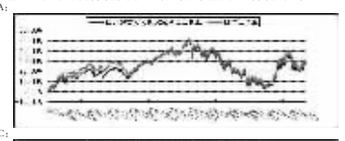
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.49%	1.51%	-2.67%	1.51%	1.18%	0.00%

2. 博时银智大数据100C:

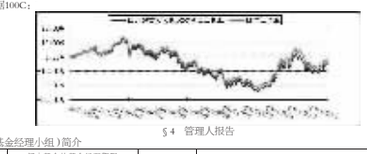
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.63%	1.51%	-2.67%	1.51%	1.04%	0.00%

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. 博时银智大数据100A:



2. 博时银智大数据100C:



§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		
杨振建	基金经理	2018-12-03	-	5.8	杨振建先生,博士,2013年至2015年在中证指数有限公司工作(期间曾调中国证监会任产品审核员),2015年加入博时基金管理有限公司,历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理,现任博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金(2018年12月3日一至今),博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金(2018年12月3日一至今)的基金经理。
柱征辉	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2016-05-20	-	9.9	柱征辉先生,硕士,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,现任指数与量化投资部投资副总监兼博时裕富沪深300指数证券投资基金(2015年7月21日一至今),博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金(2016年5月20日一至今),博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金(2016年5月20日一至今),博时中证500指数增强型证券投资基金(2017年9月26日一至今),博时富时中国A股指数证券投资基金(2018年6月12日一至今)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

2019年二季度,A股市场出现明显回调,之后进入震荡期,最终收于2980点左右。风格方面,下跌中,小盘及创业板跌幅更大,大盘相对抗跌,反转效应明显。行业方面食品饮料、家电、银行等行业大幅跑赢市场,传媒及综合行业表现落后。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。

展望2019年三季度,我国经济下行的压力依旧存在,短期内中美贸易摩擦有所缓和,但中长期风险仍在。虽然外部环境的压力可能对出口构成压力,制造业投资也难以显著改善,但是预计减税降费和财政政策的积极有望再下半年支撑消费、制造业投资并明显提振基建投资。货币方面,内外部环境对货币条件边际松动的掣肘在下半年会趋于减弱,转向逆周期调节的概率在增大。当前A股市场风险偏好仍有提升的空间,但应密切关注政策走向及贸易战情况。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年06月30日,本基金A类基金份额净值为1.2869元,份额累计净值为1.2869元,本基金C类基金份额净值为1.2727元,份额累计净值为1.2727元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为-1.49%,本基金C类基金份额净值增长率为-1.63%,同期业绩基准增长率-2.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自于2019年4月10日至2019年6月28日出现连续20个工作日资产少于5000万的情形。

§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	38,810,203.79	92.65
	其中:股票	38,810,203.79	92.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	199,840.00	0.48
	其中:债券	199,840.00	0.48
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,740,009.03	6.54
8	其他各项资产	138,833.37	0.33
9	合计	41,888,886.19	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	1,166,100.00	2.84
B	采矿业	404,510.30	0.99
C	制造业	15,652,223.12	38.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,465,940.00	3.57
E	建筑业	1,131,144.00	2.76
F	批发和零售业	1,536,054.40	3.75
G	交通运输、仓储和邮政业	1,220,174.00	2.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,012,193.60	4.91
J	金融业	11,225,483.37	27.37
K	房地产业	2,182,694.00	5.32
L	租赁和商务服务业	425,520.00	1.04
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	388,167.00	0.95
S	综合	-	-
	合计	38,810,203.79	94.64

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	300014	亿纬锂能	15,200	462,992.00	1.13
2	601233	桐昆股份	29,500	457,545.00	1.12
3	600809	山西汾酒	6,500	448,825.00	1.09
4	603160	汇顶科技	3,200	444,160.00	1.08
5	300628	亿联网络	4,100	438,987.00	1.07
6	603369	今世缘	15,700	437,873.00	1.07
7	000568	泸州老窖	5,400	436,482.00	1.06
8	600030	中信证券	18,100	430,961.00	1.05
9	000596	古井贡酒	3,600	426,636.00	1.04
10	601888	中国国旅	4,800	425,520.00	1.04

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	199,840.00	0.49
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	199,840.00	0.49

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	019611	19国债01	2,000	199,840.00	0.49

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,本基金投资的前十名证券的发行主体被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	14,848.23
2	应收证券清算款	101,884.45
3	应收股利	-
4	应收利息	2,696.88
5	应收申购款	19,403.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,833.37

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	博时银智大数据100A	博时银智大数据100C
本报告期期初基金份额总额	37,184,418.70	675,598.98
报告期基金总申购份额	2,023,518.66	117,287.23
减:报告期基金总赎回份额	7,925,706.33	200,146.93
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,282,231.03	592,739.28

§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