# 博时丝路主题股票型证券投资基金

## 【2015】年度报告摘要

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：二〇一六年三月二十六日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自2015年5月22日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 博时丝路主题股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 博时丝路主题股票基金 |
| 基金主代码 | 001236 |
| 交易代码 | 001236 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年5月22日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,196,759,565.45份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过重点投资受益于中国资本输出的标的，在严控风险和良好流动性的情况下，力求为基金持有人创造良好的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金为股票型基金。投资策略主要包括资产配置策略、行业选择策略和个股选择策略三部分。其中，资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。在行业选择层面，主要是结合宏观和政策环境判断，研究中国对外资本输出和金融贸易开放进程和产业路径，形成行业配置思路。在个股投资层面，本基金将坚持估值与成长相结合，对企业基本面和长期竞争力进行严格评判。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×90%+中国债券总指数收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险/预期收益特征的开放式基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 博时基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 孙麒清 | 王永民 |
| | 联系电话 | 0755-83169999 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | service@bosera.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 95105568 | 95566 |
| 传真 | | 0755-83195140 | 010-66594942 |
| 注册地址 | | 广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层 | 北京市西城区复兴门内大街1号 |
| 办公地址 | | 广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层 | 北京市西城区复兴门内大街1号 |
| 邮政编码 | | 518040 | 100818 |
| 法定代表人 | | 张光华 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、证券时报、上海证券报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.bosera.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015年5月22日（基金合同生效日）至2015年12月31日 |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -565,309,573.55 |
| 本期利润 | -259,593,157.42 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1217 |
| 本期加权平均净值利润率 | -15.23% |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.70% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2015年12月31日） |
| 期末可供分配利润 | -553,371,965.17 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2519 |
| 期末基金资产净值 | 2,027,535,176.61 |
| 期末基金份额净值 | 0.923 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2015年12月31日） |
| 基金份额累计净值增长率 | -7.70% |

注：本基金合同生效日为2015年5月22日，基金合同生效日起未满一年。

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。

上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。

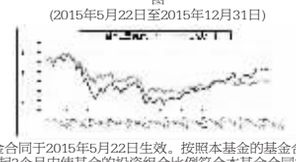
3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 44.44% | 2.50% | 15.16% | 1.50% | 29.28% | 1.00% |
| 过去六个月 | 9.23% | 3.46% | -14.27% | 2.41% | 23.50% | 1.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.70% | 3.44% | -20.04% | 2.53% | 12.34% | 0.91% |

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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

博时丝路主题股票型证券投资基金
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年5月22日至2015年12月31日)



注：本基金合同于2015年5月22日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起3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。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时丝路主题股票型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

3.3过去三年基金的利润分配情况
无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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2015年12月31日，博时基金公司共管理八十五只开放式基金，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。资产管理净值总规模逾3980亿元人民币，其中公募基金资产规模约2054亿元人民币，累计分红约677亿元人民币，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12月31日，指数股票型基金中，博时深证基本面200ETF及深证基本面200ETF联接，今年以来净值增长率在同类型分别排名前1/2和1/3；偏股型的混合基金里，博时创业成长混合及博时卓越品牌混合，今年以来净值增长率在同类型基金中分别排名前1/4和1/3；灵活配置型的混合基金里，裕隆灵活配置混合今年以来净值增长率在101只同类型中排名前1/2；灵活策略混合基金里，博时裕益及博时回报，在39只同类基金分别排名前1/5和1/3。

固定收益方面，博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来净值增长率在19只同类封闭式长期标准债券型基金中排名第一；在长期标准债券型基金中，博时安心收益定期开放债券C类今年以来净值增长率在同类排名前1/7，安心A类排名前1/6，博时信用债纯债A及博时优势收益信用债，在70只同类中排名前1/2；中短期标准债券基金A类里，博时安盈债券A在同类排名第二；普通债券型基金里，博时稳定价值债券A类在同类85只排名前1/9，博时稳定价值债券B类在50只同类排名前10%；可转换债券型基金A类和指数债券型基金A类里，博时转债增强债券A及博时上证企债30ETF在同类基金中排名前1/2；货币市场基金中，博时现金宝货币A在同类146只排名前1/3。

2、其他大事件

2015年12月18日，由东方财富网主办的2015年东方财富风云榜活动在深举行，博时基金荣获“2015年度最优QDII产品基金公司奖”。

2015年12月17日，由华夏日报主办第九届机构投资者年会暨金蝉奖颁奖盛典，博时基金荣获“2015年度最具互联网创新基金公司”。

2015年12月16日，由北京商报主办的2015北京金融论坛，博时基金荣获“品牌推广卓越奖”。

2015年12月11日，由第一财经日报主办的2015金融价值榜典礼在北京金融街威斯汀酒店举行，博时基金荣获“最佳财富管理金融机构”大奖。

2015年12月11日，由21世纪经济报道主办的2015亚洲资本年会在深圳洲际酒店举行，博时基金获评“2015最受尊敬基金公司”、张光华董事长获评“2015中国赢基金任务奖”。

2015年12月4日，由经济观察报主办的2014-2015年度中国卓越金融奖颁奖典礼在北京举行，博时基金凭借旗下固定收益类的出色表现，独家获评“年度卓越固定收益投资团队奖”。

2015年11月26日，由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的CFAC中国金融年会在深召开，博时基金荣获“年度最佳基金公司”大奖。

2015年11月20日，第十一届中国证券市场年会，博时基金获评“年度卓越贡献龙鼎奖”。

2015年11月7日，由每日经济新闻主办的第四届中国上市公司领袖峰会在成都香格里拉举行，博时资本荣获“最具成长性子公司”。

2015年8月3日，博时基金经理过钧和陈溪冈，荣获证券时报颁发的“英华奖”；同时，过钧获得证券时报评选的“三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理”，张溪冈获得证券时报评选的“三年期海外投资-最佳基金经理”。

2015年4月22日，在由上海证券报社主办的第十二届中国“金基金”奖的评选中，博时主题行业股票证券投资基金(LOF)获得金基金·5年期股票型金基金奖。

2015年4月17日，在由证券时报社主办，晨星资讯、上海证券和济安金信提供评奖支持的2014年度“中国基金业明星基金奖”评选中，博时基金旗下博时主题行业与博时信用债分别获得五年持续回报股票型明星基金奖、2014年度积极债券型明星基金奖。

2015年3月28日，在第十二届中国基金业金牛奖评选中，博时基金旗下博时主题行业（LOF）基金、博时信用债券基金分别获得“2014年度开放式股票型金牛基金”奖、“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2015年1月21日，在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中，博时转债增强荣获第八届金蝉奖“2014最佳年度债基品牌奖”。

2015年1月18日，博时基金（香港）在和讯财经风云榜海外评选中荣获“最佳中资基金公司”奖。

2015年1月15日，在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中，博时基金获评第十二届中国财经风云榜“年度十大品牌基金公司”奖。

2015年1月11日，在和讯网主办的2013年第十一届财经风云榜基金行业评选中，博时基金荣获“2013年度基金业最佳投资者关系奖”。

2015年1月7日，博时基金在2014年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王俊 | 研究部总经理/基金经理 | 2015-05-22 | - | 7 | 2008年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司，历任研究员、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合(LOF)基金的基金经理。 |
| 沙炜 | 基金经理 | 2015-05-22 | - | 7 | 2008年从中国科学院硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、资深研究员、基金经理助理、研究部副总经理。现任博时丝路主题股票基金兼博时招财一号保本基金的基金经理。 |

注：上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、基金合同和其他相关法律法规的规定，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，在严格控制风险的基础上，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 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《公平交易管理制度》的规定，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

本基金于15年5月22日完成募集，截止2015年末，本基金净值下跌7.7%，高于业绩基准约12.5个百分点。在本基金募集完成后，A股市场巨幅震荡，本基金组合保持了基本稳定的仓位和结构，行业配置上主要是原材料、TMT、军工、交运等。从各行业表现来看，在市场大幅波动情况下，基本达到了预期收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金份额净值为0.923元，累计份额净值为0.923元，报告期内净值增长率为-7.70%，同期业绩基准涨幅为-20.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年，中国GDP增速6.9%，预期2016年会进一步下滑，实体经济增速压力仍大；另一方面，2015年中国经济转型力度在加大，第三产业增速达到8.3%，且增量占比高达88%，显著高于过去几年平均值；同时中国对外投资保持较快增长，规模达到1180亿美元，同比增长14.7%。2015年，中国货币政策持续宽松，连续多次降息降准，目前利率已处于20多年来最低水平。预计2016年，中国会加大稳增长的政策，货币政策会继续宽松，但外部经济环境和汇率压力可能会阶段性制约宽松力度，边际来看宽松力度可能会下降。各种因素纠结在一期，A股市场的不确定性增大，在此背景下，本基金会继续坚持投资策略和风格，自下而上寻找具有中期成长性的投资标的。

本基金基本投资策略是选择受益于中国资本输出的产业，2016年会继续在这一大逻辑下寻找投资机会，主要侧重三方面：一是材料、交运、军工、旅游、建筑等偏传统行业，直接受益于中国资本和产能输出；二是中国正在快速发展的，有望领导全球经济格局的新兴产业，主要聚焦TMT等领域，如云计算、智能制造等；同时积极关注中国企业的海外并购带来的投资机遇。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2015年，我公司根据法律、法规的规定，制定、修订和完善了《博时基金融资融券及转融通投资管理制度》、《博时基金管理有限公司产品委员会制度》、《投资决策委员会制度》、《风险管理委员会制度》、《债券型基金股票投资管理流程》、《股票池管理办法》、《债券池管理办法》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 基金持有人数或资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对博时丝路主题股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时丝路主题股票型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产： | | - |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 215,657,839.42 |
| 结算备付金 | | 7,542,848.36 |
| 存出保证金 | | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,838,836,443.65 |
| 其中：股票投资 | | 1,838,836,443.65 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - |
| 应收证券清算款 | | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 47,453.45 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 5,387,011.41 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 2,067,471,596.29 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015年12月31日 |
| 负 债： | | - |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付证券清算款 | | 23,284,399.70 |
| 应付赎回款 | | 10,574,348.01 |
| 应付管理人报酬 | | 2,390,622.38 |
| 应付托管费 | | 398,437.08 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 3,103,197.99 |
| 应交税费 | | - |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 185,414.52 |
| 负债合计 | | 39,936,419.68 |
| 所有者权益： | | - |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 2,196,759,565.45 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | -169,224,388.84 |
| 所有者权益合计 | | 2,027,535,176.61 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,067,471,596.29 |

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值0.923元，基金份额总额2,196,759,565.45份。本财务报表的实际编制期间为2015年5月22日(基金合同生效日)至2015年12月31日

7.2 利润表

会计主体：博时丝路主题股票型证券投资基金

本报告期：2015年5月22日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015年5月22日（基金合同生效日）至2015年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | | -227,965,339.09 |
| 1.利息收入 | | 1,403,359.40 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 1,403,359.40 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -537,152,945.88 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | -540,465,119.74 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 3,312,173.86 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 305,716,416.13 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 2,067,831.26 |
| 减：二、费用 | | 31,627,818.33 |
| 1. 管理人报酬 | | 15,457,005.09 |
| 2. 托管费 | | 2,576,167.56 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 13,311,845.59 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 282,800.09 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -259,593,157.42 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -259,593,157.42 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时丝路主题股票型证券投资基金

本报告期：2015年5月22日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年5月22日（基金合同生效日）至2015年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 2,311,523,643.44 | - | 2,311,523,643.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -259,593,157.42 | -259,593,157.42 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -114,764,077.99 | 90,368,768.58 | -24,395,309.41 |
| 其中：1.基金申购款 | 592,625,084.96 | -99,391,716.14 | 493,233,368.81 |
| 2.基金赎回款 | -707,389,162.94 | 189,760,484.72 | -517,628,678.22 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,196,759,565.45 | -169,224,388.84 | 2,027,535,176.61 |

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额总额2,196,759,565.45份。本财务报表的实际编制期间为2015年5月22日(基金合同生效日)至2015年12月31日

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 1,838,836,443.65 | 88.94 |
| | 其中：股票 | 1,838,836,443.65 | 88.94 |
| 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 | 223,200,687.78 | 10.80 |
| 7 | 其他各项资产 | 5,434,464.86 | 0.26 |
| 8 | 合计 | 2,067,471,596.29 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,371,458,942.73 | 67.64 |
| 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 | 18,620,548.00 | 0.92 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 66,866,980.00 | 3.30 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 381,889,972.92 | 18.84 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 1,838,836,443.65 | 90.69 |

8.3 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 金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300230 | 永利股份 | 5,017,665 | 187,510,141.05 | 9.25 |
| 2 | 002292 | 奥飞动漫 | 2,647,427 | 136,898,450.17 | 6.75 |
| 3 | 002502 | 骅威股份 | 3,474,622 | 111,257,396.44 | 5.49 |
| 4 | 300038 | 梅泰诺 | 1,725,387 | 97,794,935.16 | 4.82 |
| 5 | 300287 | 飞利信 | 4,978,959 | 90,119,157.90 | 4.44 |
| 6 | 300363 | 博腾股份 | 2,921,768 | 79,267,565.84 | 3.91 |
| 7 | 002643 | 万润股份 | 1,944,906 | 78,827,040.18 | 3.89 |
| 8 | 600562 | 国睿科技 | 1,119,353 | 69,612,563.07 | 3.43 |
| 9 | 601021 | 春秋航空 | 1,096,180 | 66,866,980.00 | 3.30 |
| 10 | 002284 | 亚太股份 | 3,180,512 | 65,772,988.16 | 3.24 |
| 11 | 300379 | 东方通 | 534,646 | 65,595,717.74 | 3.24 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600068 | 葛洲坝 | 192,913,065.52 | 9.51 |
| 2 | 300159 | 新研股份 | 172,183,418.74 | 8.49 |
| 3 | 300292 | 吴通控股 | 135,362,333.15 | 6.68 |
| 4 | 002256 | 彩虹精化 | 131,595,661.19 | 6.49 |
| 5 | 601021 | 春秋航空 | 126,275,168.66 | 6.23 |
| 6 | 300363 | 博腾股份 | 115,143,623.30 | 5.68 |
| 7 | 603338 | 浙江鼎力 | 114,773,223.87 | 5.66 |
| 8 | 600105 | 永鼎股份 | 113,262,714.64 | 5.59 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 109,900,274.01 | 5.42 |
| 10 | 002502 | 骅威股份 | 104,609,988.57 | 5.16 |
| 11 | 002037 | 久联发展 | 104,279,405.46 | 5.14 |
| 12 | 300156 | 神雾环保 | 101,451,066.52 | 5.00 |
| 13 | 300287 | 飞利信 | 98,286,252.84 | 4.85 |
| 14 | 002520 | 日发精机 | 97,572,658.22 | 4.81 |
| 15 | 002292 | 奥飞动漫 | 94,817,125.88 | 4.68 |
| 16 | 300230 | 永利股份 | 94,795,656.51 | 4.68 |
| 17 | 002299 | 圣农发展 | 93,923,808.16 | 4.63 |
| 18 | 000910 | 大亚科技 | 81,767,799.80 | 4.03 |
| 19 | 603308 | 应流股份 | 78,362,877.08 | 3.86 |
| 20 | 600562 | 国睿科技 | 76,166,403.67 | 3.76 |
| 21 | 002733 | 雄韬股份 | 74,034,999.80 | 3.65 |
| 22 | 600391 | 成发科技 | 71,665,117.83 | 3.53 |
| 23 | 002643 | 万润股份 | 71,570,791.80 | 3.53 |
| 24 | 002398 | 建研集团 | 70,786,950.76 | 3.49 |
| 25 | 000065 | 北方国际 | 70,332,677.47 | 3.47 |
| 26 | 300017 | 网宿科技 | 69,179,909.34 | 3.41 |
| 27 | 002431 | 棕榈园林 | 68,994,857.34 | 3.40 |
| 28 | 000768 | 中航飞机 | 67,729,621.92 | 3.34 |
| 29 | 300011 | 鼎汉技术 | 67,336,468.58 | 3.32 |
| 30 | 600761 | 安徽合力 | 67,276,819.25 | 3.32 |
| 31 | 002585 | 双星新材 | 63,802,382.05 | 3.15 |
| 32 | 300432 | 富临精工 | 62,777,534.28 | 3.10 |
| 33 | 600855 | 航天长峰 | 62,697,400.88 | 3.09 |
| 34 | 000973 | 佛塑科技 | 62,623,999.51 | 3.09 |
| 35 | 600029 | 南方航空 | 61,507,646.04 | 3.03 |
| 36 | 300038 | 梅泰诺 | 60,607,710.12 | 2.99 |
| 37 | 000593 | 大通燃气 | 59,729,759.92 | 2.95 |
| 38 | 600373 | 中文传媒 | 58,515,531.01 | 2.89 |
| 39 | 001896 | 豫能控股 | 57,932,313.54 | 2.86 |
| 40 | 600470 | 六国化工 | 56,964,319.03 | 2.81 |
| 41 | 300379 | 东方通 | 56,197,312.28 | 2.77 |
| 42 | 300250 | 初灵信息 | 56,101,319.80 | 2.77 |
| 43 | 002250 | 联化科技 | 54,417,072.88 | 2.68 |
| 44 | 600865 | 百大集团 | 54,164,678.40 | 2.67 |
| 45 | 300367 | 东方网力 | 54,142,481.44 | 2.67 |
| 46 | 300339 | 润和软件 | 54,096,341.98 | 2.67 |
| 47 | 300218 | 安利股份 | 53,753,330.87 | 2.65 |
| 48 | 601599 | 鹿港科技 | 53,231,963.91 | 2.63 |
| 49 | 002445 | 中南重工 | 52,836,581.08 | 2.61 |
| 50 | 002284 | 亚太股份 | 52,809,748.23 | 2.60 |
| 51 | 300198 | 纳川股份 | 52,313,077.58 | 2.58 |
| 52 | 300381 | 溢多利 | 52,282,252.87 | 2.58 |
| 53 | 002094 | 青岛金王 | 51,771,159.88 | 2.55 |
| 54 | 002368 | 太极股份 | 51,722,141.00 | 2.55 |
| 55 | 002557 | 洽洽食品 | 50,456,043.04 | 2.49 |
| 56 | 300342 | 天银机电 | 49,808,220.35 | 2.46 |
| 57 | 600098 | 广州发展 | 49,734,955.50 | 2.45 |
| 58 | 300136 | 信维通信 | 48,703,861.42 | 2.40 |
| 59 | 300214 | 日科化学 | 46,781,592.90 | 2.31 |
| 60 | 000750 | 国海证券 | 46,221,198.00 | 2.28 |
| 61 | 300397 | 天和防务 | 46,098,695.75 | 2.27 |
| 62 | 300448 | 浩云科技 | 45,699,776.00 | 2.25 |
| 63 | 002521 | 齐峰新材 | 45,140,334.12 | 2.23 |
| 64 | 603686 | 龙马环卫 | 45,040,075.00 | 2.22 |
| 65 | 002071 | 长城影视 | 44,899,759.39 | 2.21 |
| 66 | 002175 | 东方网络 | 44,382,799.00 | 2.19 |
| 67 | 600476 | 湘邮科技 | 44,168,842.35 | 2.18 |
| 68 | 300364 | 中文在线 | 43,957,929.32 | 2.17 |
| 69 | 600011 | 华能国际 | 43,729,232.52 | 2.16 |
| 70 | 600028 | 中国石化 | 43,238,005.60 | 2.13 |
| 71 | 600703 | 三安光电 | 43,208,443.40 | 2.13 |
| 72 | 600804 | 鹏博士 | 42,581,028.78 | 2.10 |
| 73 | 600556 | 慧球科技 | 41,724,656.00 | 2.06 |
| 74 | 600282 | 南钢股份 | 41,140,177.40 | 2.03 |

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 603338 | 浙江鼎力 | 124,411,536.34 | 6.14 |
| 2 | 600068 | 葛洲坝 | 121,475,940.90 | 5.99 |
| 3 | 600105 | 永鼎股份 | 92,571,186.09 | 4.57 |
| 4 | 300156 | 神雾环保 | 90,884,880.42 | 4.48 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 88,718,297.52 | 4.38 |
| 6 | 300292 | 吴通控股 | 84,291,156.15 | 4.16 |
| 7 | 002520 | 日发精机 | 75,139,543.39 | 3.71 |
| 8 | 002256 | 彩虹精化 | 73,252,527.62 | 3