

## 嘉实黄金证券投资基金（LOF）

## 【2013】半年度报告摘要

会计主体:嘉实黄金证券投资基金 40F)

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

| 项目                              | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |                | 所有者权益合计        |
|---------------------------------|----------------------------|----------------|----------------|
|                                 | 实收基金                       | 未分配利润          |                |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                 | 272,614,557.65             | -17,579,634.49 | 255,034,923.16 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)        | -                          | -65,914,199.98 | -65,914,199.98 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(其中:1.基金申购款 | -30,830,296.04             | 6,383,310.14   | -24,446,985.90 |
| 2.基金赎回款                         | 22,071,673.98              | -3,149,844.17  | 18,921,829.81  |
| 四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动        | -52,901,970.02             | 9,533,154.31   | -43,368,815.71 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                 | 241,784,261.61             | -77,110,524.33 | 164,673,737.28 |

| 项目                              | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |                | 所有者权益合计        |
|---------------------------------|---------------------------------|----------------|----------------|
|                                 | 实收基金                            | 未分配利润          |                |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                 | 388,083,475.54                  | -27,227,297.14 | 360,856,178.40 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)        | -                               | 172,849.85     | 172,849.85     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(其中:1.基金申购款 | -72,195,673.99                  | 1,234,820.38   | -70,960,853.61 |
| 2.基金赎回款                         | 11,367,835.62                   | -449,214.17    | 10,918,621.45  |
| 四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动        | -83,563,509.61                  | 1,684,034.55   | -81,879,475.06 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                 | 315,887,801.55                  | -25,819,626.91 | 290,068,174.64 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 赵学军      | 李松林       | 王红      |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明  
本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期无须说明的会计差错更正。

## 6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况  
本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的相关关联方

| 关联方名称  | 与本基金的关系      |
|--|--------------|
| 嘉实基金管理有限公司   | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)                                 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 纽约梅隆银行股份有限公司 (The Bank of New York Mellon Corporation) | 境外资产托管人      |

## 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期 2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

## 6.4.4.2 关联方报酬

## 6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目              | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,111,563.83               | 1,618,967.37                    |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 354,596.35                 | 517,532.36                      |

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

## 6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目             | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 289,006.68                 | 420,931.54                      |

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.26%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.26% / 当年天数。

## 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期 2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日),本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

## 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期 2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末 2013年6月30日)及上年度末 2012年12月31日),其他关联方未持有本基金。

## 6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称   | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日<br>期末余额 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日<br>期末余额 | 当期利息收入        |
|---|------------------------------------|---|---------------|
| 中国工商银行  | 7,395,808.50                       | 17,914.33                               | 89,899.10     |
| 纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation) | 10,970,199.98                      | -                                       | 15,360,092.39 |

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation)保管,按适用利率计息。

## 6.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

本期 2013年1月1日至2013年6月30日)及上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日),本基金未在承销期间参与认购关联方承销的证券。

## 6.4.5 期末 2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券  
本期末 2013年6月30日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

## 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末 2013年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

## 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末 2013年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

## 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末 2013年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

## §7 投资组合报告

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         | -              | -            |
| 其中:普通股            | -            | -              | -            |
| 优先股               | -            | -              | -            |
| 2                 | 固定收益投资       | -              | -            |
| 其中:债券             | -            | -              | -            |
| 资产支持证券            | -            | -              | -            |
| 3                 | 金融衍生品投资      | -              | -            |
| 其中:远期             | -            | -              | -            |
| 期货                | -            | -              | -            |
| 4                 | 买入返售金融资产     | -              | -            |
| 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | -            | -              | -            |
| 5                 | 其他资产         | -              | -            |
| 其中:应收股利           | -            | -              | -            |
| 6                 | 其他资产         | -              | -            |
| 7                 | 银行存款和结算备付金合计 | 18,366,008.48  | 10.72        |
| 8                 | 其他各项资产       | 5,981,032.95   | 3.49         |
| 合计                |              | 171,359,139.30 | 100.00       |

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

基金管理人:嘉实基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
送出日期:2013年8月26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。本半年度报告已经全部独立审计签字同意,并由董事长签发。

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2013年8月20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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

## §2 基金简介

|              |                               |
|--------------|-------------------------------|
| 2.1 基金基本情况   |                               |
| 基金名称         | 嘉实黄金证券投资基金(LOF)               |
| 基金简称         | 嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)(场内简称:嘉实黄金) |
| 基金代码         | 160719                        |
| 基金运作方式       | 上市型契约开放式(LOF)                 |
| 基金合同生效日      | 2011年8月4日                     |
| 基金管理人        | 嘉实基金管理有限公司                    |
| 基金托管人        | 中国工商银行股份有限公司                  |
| 报告期末基金份额总额   | 241,784,261.61份               |
| 基金合同存续期      | 不定期                           |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                       |
| 上市日期         | 2012年2月10日                    |

|            |   |
|------------|---|
| 2.2 基金产品说明 |   |
| 投资目标       | 本基金主要投资于境外市场以实物黄金为支持的交易所交易基金等金融工具,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争实现对国际市场价格走势的有效跟踪。  |
| 投资策略       | 本基金主要通过投资于海外市场跟踪黄金价格的交易所交易基金(ETF)以实现对黄金价格的有效跟踪,所投资的海外市场黄金ETF将具有以实物黄金支持的金融工具支持,具体包括(1)ETF组合管理策略;本基金遴选出在全球发达市场上市的有实物黄金支持的优质黄金ETF,基本上采取买入持有的投资策略;(2)现金管理策略;(3)衍生品投资策略。 |
| 业绩比较基准     | (经汇率调整后的)伦敦金价格  |
| 风险收益特征     | 本基金属于基金中基金。本基金的表现与黄金价格走势直接相关,预期收益可能长期超过或低于股票、债券等传统金融资产。   |

| 项目      |                    | 基金管理人                                    | 基金托管人                                       |
|---------|--------------------|--|---|
| 名称      |                    | 嘉实基金管理有限公司                               | 中国工商银行股份有限公司                                |
| 信息披露负责人 | 姓名<br>联系电话<br>电子邮箱 | 胡勇钦<br>(010)65215588<br>service@jfund.cn | 赵会军<br>(010)66105799<br>custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |                    | 400-600-8800                             | 95588                                       |
| 传真      |                    | (010)65182266                            | (010)66105798                               |

|             |   |
|-------------|---|
| 2.4 境外资产托管人 |   |
| 项目          | 境外资产托管人                                 |
| 名称          | The Bank of New York Mellon Corporation |
| 注册地         | 纽约梅隆银行股份有限公司                            |
| 办公地址        | One Wall Street, New York, NY 10286     |
| 邮政编码        | One Wall Street, New York, NY 10286     |

|                      |                                 |
|----------------------|---------------------------------|
| 2.5 信息披露方式           |                                 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jsfund.cn            |
| 基金半年度报告备置地点          | 北京市建国门内大街8号华润大厦8层<br>嘉实基金管理有限公司 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 金额单位:人民币元 |
|-----------------|-----------|

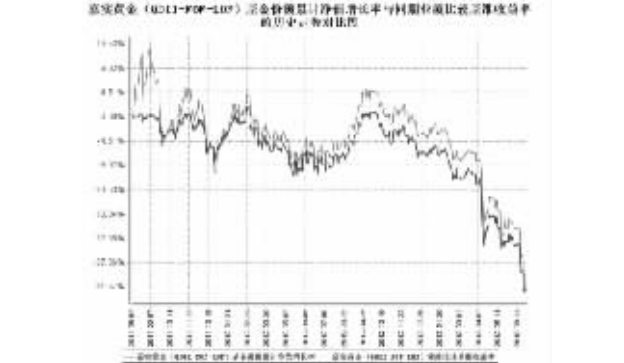
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | -11,061,420.63            |
| 本期利润          | -65,914,199.98            |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.2507                   |
| 本期加权平均净值利润率   | -29.46%                   |
| 本期基金份额净值增长率   | -27.24%                   |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | -77,110,524.33            |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.3189                   |
| 期末基金资产净值      | 164,673,737.28            |
| 期末基金份额净值      | 0.681                     |
| 3.1.3 累计净值指标  | 报告期末(2013年6月30日)          |
| 基金份额净值增长率     | -31.90%                   |

注:①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;②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期末可供分配利润采用期末资产负债表末中分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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 | 业绩比较基准收益率② | 业绩比较基准收益率③ | ①-③   | ②-①   |        |
| 过去一个月                            | -11.33%  | 1.62%      | -14.53%    | 1.68% | 3.20% | -0.06% |
| 过去三个月                            | -23.65%  | 1.76%      | -26.49%    | 1.84% | 2.84% | -0.08% |
| 过去六个月                            | -27.24%  | 1.35%      | -29.31%    | 1.41% | 2.07% | -0.06% |
| 过去一年                             | -25.82%  | 1.05%      | -27.15%    | 1.13% | 1.33% | -0.10% |
| 自基金合同生效起至今                       | -31.90%  | 0.95%      | -31.53%    | 1.34% | 0.77% | -0.39% |

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

图:嘉实黄金 QDII-FOF-LOF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
2011年8月4日至2013年6月30日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二)二)投资范围和(六)投资限制二)投资组合限制)的有关规定。

## §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  
本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,公司总部设在北京、在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。  
截止2013年6月30日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金,47只开放式证券投资基金,具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金 QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产(QDI)、嘉实理财7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中债企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金债中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产管理组合。

4.1.2 基金经理 戴金彪基金经理小组 及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理(助理)期限<br>任职日期 | 证券从业年限 | 说明   |
|----|--|-------------------------|--------|--|
| 杨阳 | 本基金、嘉实基本50指数(LOF)、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实H股指数(QDII-LOF)基金经理 | 2011年8月4日               | 13年    | 曾任贝尔斯登高级工程师、HBK投资公司高级工程师/交易员、Citadel投资集团高级数量分析师,2008年3月加入嘉实基金任高级数量分析师。宾夕法尼亚州立大学硕士,具有基金从业资格,中国国籍。 |

注:①)任职日期指指本基金基金合同生效之日;②)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  
《证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求