

# 嘉实黄金证券投资基金 (LOF)

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:2018年08月25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法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,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2018年8月22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请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2018年1月1日起至2018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(CSIH-FOP-LOF)
缩略名称	嘉实黄金
基金代码	160719
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2011年10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	254,336,072.14份
基金合同的存续期	不定期
基金上市的交易交易所	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:本基金主要投资于海外市场跟踪的黄金期货合约及黄金ETF等黄金资产,通过多资产配置策略来分散投资风险,力争实现投资资产的长期增值。

投资策略:本基金主要投资于海外市场跟踪的黄金期货合约及黄金ETF等黄金资产,通过多资产配置策略来分散投资风险,力争实现投资资产的长期增值。

### 2.3 基金管理人及基金托管人

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
负责人	魏善春	姜健
联系电话	010-59028888	010-66108888
电子邮箱	service@jsgf.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务热线	400-600-8800	95588
传真	010-59028888	010-66108888

### 2.4 境外资产托管人

项目	境外资产托管人
名称	纽约梅隆银行股份有限公司
英文名称	The Bank of New York Mellon Corporation
注册地址	240 Greenwich Street, New York, NY 10286
办公地址	240 Greenwich Street, New York, NY 10286
网站地址	www.bnmf.com

### 2.5 信息披露方式

本基金半年度报告正文的交易网址及互联网网址: <http://www.jsfund.com>

## § 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

项目	金额单位:人民币元
3.1.1 期间数据	报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)
本期利润总额	-269,198.33
本期净利润	-5,396,705.01
加权平均基金份额本期利润	-0.02134
本期加权平均净值增长率	-3.26%
本报告期末基金份额总额	254,336,072.14份
报告期末基金份额净值	1.0000
报告期末基金份额持有人户数	71,464,647.28户

### 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	业绩比较基准收益率	超额收益	跟踪误差
过去一个月	-0.07%	0.27%	-1.34%	0.42%
过去三个月	-1.02%	0.87%	-1.89%	0.65%
过去六个月	-2.87%	0.57%	-3.44%	0.95%
过去一年	-3.87%	0.64%	-4.51%	1.12%
过去三年	566%	0.74%	565%	0.61%
自基金合同生效以来	-31.00%	-31.00%	0.00%	-0.00%

#### 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

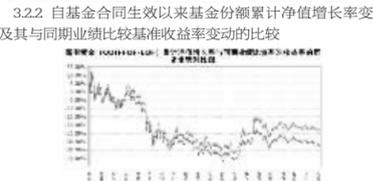


图:嘉实黄金(OdII-FOP-LOF)基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

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)“投资组合限制”和(六)“投资限制(二)投资组合限制”的有关约定。

### § 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26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、北京怀柔设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和ODII、特定资产管理业务资格。

##### 4.1.2 基金经理

截止2018年6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、142只开放式证券投资基金,具体包括嘉实元和、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、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300 ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题精选混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国混合(ODII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(ODII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(ODII-FOP-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产(ODII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(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、嘉实中证阿尔法中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实安A/B、嘉实活期货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝

#### 4.2 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年上半年,国际市场价格在经历4个月的震荡之后而缓慢下跌,整体下跌2.43%。前4月多空力量相互抗衡,交替影响。一方面,美国经济数据向好,就业情况超预期,通胀回升,美联储加息预期压制金价上探;另一方面,地缘政治风险事件风起云涌,贸易战拉大帷幕,朝美会谈一波三折,美国退出伊核协议,欧洲政治乱局,避险情绪升温推升金价。5月之后,美国经济持续增长,加息预期不断强化,美元指数保持强势态势,这些因素导致金价震荡下行。

#### 4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计4次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

#### 4.4 报告期内基金投资组合情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

##### 4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.681元;本报告期基金份额净值增长率为-3.40%,业绩比较基准收益率为-1.92%。

##### 4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金以跟踪国际市场价格走势为主要投资管理目标,秉承在基金合同约定下维持较高仓位运作以及谨慎调整的经营理念,基金收益力争反映国际市场价格走势。本基金在兼顾流动性、跟踪误差以及投资管理水平的管理基础上,筛选出全球发达市场上有实物黄金支持的黄金ETF,通过投资于有实物黄金支持的黄金ETF的方式达成跟踪金价的投资目标。

##### 4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值委员会与托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中度和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

##### 4.7 基金管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人估值委员会与托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中度和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

##### 4.8 报告期内管理人对于本基金持有人数或基金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,本基金托管人在对嘉实黄金证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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,嘉实黄金证券投资基金(LOF)的管理人—嘉实基金管理有限公司在嘉实黄金证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制的嘉实黄金证券投资基金(LOF)2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

项目	2018年1月1日	2018年6月30日	2017年12月31日
资产:			
货币资金	6,471	9,194,060.08	9,738,794.63
结算备付金	-	-	-
交易性金融资产	6,472	144,592,049.27	103,964,401.42
其中:股票投资	-	-	-
基金投资	-	144,592,049.27	103,964,401.42
债券投资	-	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
贵金属投资	-	-	-
应收利息	6,476	1,177.35	2,546.66
应收股利	-	-	-
可供出售金融资产	6,474	-	-
持有至到期投资	-	-	-
长期股权投资	-	-	-
投资性房地产	-	-	-
固定资产	-	-	-
在建工程	-	-	-
无形资产	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	12,948	144,796,117.43	113,703,742.71
负债:			
短期借款	-	-	-
应付票据	-	-	-
应付账款	-	-	-
预收款项	-	-	-
应付职工薪酬	-	-	-
应交税费	-	-	-
应付利息	-	-	-
应付股利	-	-	-
其他负债	-	-	-
负债合计	-	-	-
所有者权益:			
实收资本	6,476	103,896,474.69	174,362,340.00
未分配利润	-	-	-
所有者权益合计	6,476	103,896,474.69	174,362,340.00
总计	12,948	144,796,117.43	113,703,742.71

#### 6.2 利润表

项目	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年12月31日至2018年6月30日
一、收入		
利息收入	713,627.62	608,038.97
股利收入	139,079.10	149,150.04
公允价值变动损益	32,780.07	37,741.60
其他收入	-	-
投资收益	6,477	-
其他综合收益	-	-
合计	931,964.79	804,930.61
二、费用		
管理人报酬	6,479	224,328,072.14
托管费	6,478	-71,464,647.28
销售服务费	-	-
其他费用	-	-
合计	12,957	152,863,424.86
利润总额	918,957.82	652,067.15
所得税费用	-	-
净利润	918,957.82	652,067.15

#### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

项目	2018年1月1日	2018年6月30日	2017年12月31日
1. 实收资本	-	-4,232,705.06	36,568,031.32
2. 未分配利润	6,471	29,181,149	38,296,613
3. 其他所有者权益	-	29,181,149	38,296,613
所有者权益合计	6,471	29,181,149	38,296,613
4. 其他所有者权益	-	-	-
5. 其他所有者权益	-	-	-
6. 其他所有者权益	-	-	-
7. 其他所有者权益	-	-	-
8. 其他所有者权益	-	-	-
9. 其他所有者权益	-	-	-
10. 其他所有者权益	-	-	-
11. 其他所有者权益	-	-	-
12. 其他所有者权益	-	-	-
13. 其他所有者权益	-	-	-
14. 其他所有者权益	-	-	-
15. 其他所有者权益	-	-	-
16. 其他所有者权益	-	-	-
17. 其他所有者权益	-	-	-
18. 其他所有者权益	-	-	-
19. 其他所有者权益	-	-	-
20. 其他所有者权益	-	-	-
21. 其他所有者权益	-	-	-
22. 其他所有者权益	-	-	-
23. 其他所有者权益	-	-	-
24. 其他所有者权益	-	-	-
25. 其他所有者权益	-	-	-
26. 其他所有者权益	-	-	-
27. 其他所有者权益	-	-	-
28. 其他所有者权益	-	-	-
29. 其他所有者权益	-	-	-
30. 其他所有者权益	-	-	-
31. 其他所有者权益	-	-	-
32. 其他所有者权益	-	-	-
33. 其他所有者权益	-	-	-
34. 其他所有者权益	-	-	-
35. 其他所有者权益	-	-	-
36. 其他所有者权益	-	-	-
37. 其他所有者权益	-	-	-
38. 其他所有者权益	-	-	-
39. 其他所有者权益	-	-	-
40. 其他所有者权益	-	-	-
41. 其他所有者权益	-	-	-
42. 其他所有者权益	-	-	-
43. 其他所有者权益	-	-	-
44. 其他所有者权益	-	-	-
45. 其他所有者权益	-	-	-
46. 其他所有者权益	-	-	-
47. 其他所有者权益	-	-	-
48. 其他所有者权益	-	-	-
49. 其他所有者权益	-	-	-
50. 其他所有者权益	-	-	-
51. 其他所有者权益	-	-	-
52. 其他所有者权益	-	-	-
53. 其他所有者权益	-	-	-
54. 其他所有者权益	-	-	-
55. 其他所有者权益	-	-	-
56. 其他所有者权益	-	-	-
57. 其他所有者权益	-	-	-
58. 其他所有者权益	-	-	-
59. 其他所有者权益	-	-	-
60. 其他所有者权益	-	-	-
61. 其他所有者权益	-	-	-
62. 其他所有者权益	-	-	-
63. 其他所有者权益	-	-	-
64. 其他所有者权益	-	-	-
65. 其他所有者权益	-	-	-
66. 其他所有者权益	-	-	-
67. 其他所有者权益	-	-	-
68. 其他所有者权益	-	-	-
69. 其他所有者权益	-	-	-
70. 其他所有者权益	-	-	-
71. 其他所有者权益	-	-	-
72. 其他所有者权益	-	-	-
73. 其他所有者权益	-	-	-
74. 其他所有者权益	-	-	-
75. 其他所有者权益	-	-	-
76. 其他所有者权益	-	-	-
77. 其他所有者权益	-	-	-
78. 其他所有者权益	-	-	-
79. 其他所有者权益	-	-	-
80. 其他所有者权益	-	-	-
81. 其他所有者权益	-	-	-
82. 其他所有者权益	-	-	-
83. 其他所有者权益	-	-	-
84. 其他所有者权益	-	-	-
85. 其他所有者权益	-	-	-
86. 其他所有者权益	-	-	-
87. 其他所有者权益	-	-	-
88. 其他所有者权益	-	-	-
89. 其他所有者权益	-	-	-
90. 其他所有者权益	-	-	-
91. 其他所有者权益	-	-	-
92. 其他所有者权益	-	-	-
93. 其他所有者权益	-	-	-
94. 其他所有者权益	-	-	-
95. 其他所有者权益	-	-	-
96. 其他所有者权益	-	-	-
97. 其他所有者权益	-	-	-
98. 其他所有者权益	-	-	-
99. 其他所有者权益	-	-	-
100. 其他所有者权益	-	-	-

#### 6.4 本报告期与基金发生关联交易的各关联方