

嘉实黄金证券投资基金(LOF)

2017年度报告摘要

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03月28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3月23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2017年1月1日起至2017年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 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
基金主代码	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	245,628,19.19份
基金总资产	245,628,19.19元
基金总负债	-
基金所有者权益	245,628,19.19元
报告期末持有的证券交易所交易账户	-
上期期末持有的证券交易所交易账户	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投资标的美国及黄金类金融产品，通过投资于黄金类金融产品和黄金类金融衍生品，实现资产的保值增值。
投资策略	本基金主要通过投资于实物黄金以及黄金类金融产品（包括但不限于黄金ETF、黄金基金、黄金类金融衍生品等）实现资产的保值增值。
业绩比较基准	经托管人复核的人民币银行存款利率
风险收益特征	本基金属于货币市场基金，本基金的表现与黄金价格走势直接相关，预期收益率将长期稳定地跑赢货币市场基金。

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	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
法定代表人	胡海峰	陈四清
注册资本	0101062151588	010106105798
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街甲1号国贸大厦A座27层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100004	100032

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问人
名称	纽约梅隆银行股份有限公司
住所	The Bank of New York Mellon Corporation
法定代表人	John W. Thompson
办公地址	One Wall Street, New York, NY 10286
邮政编码	-

2.5 信息披露方式

信息披露方式	基金托管人定期公告的基金投资人互联网网址	http://www.jofund.cn
	北京分公司信息披露地点	北京市建国门外大街甲1号国贸大厦A座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

基金类型	人民币
报告期	2017年

主要财务指标	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	5,231,093.73	-2,957,661.28	-74,255,877.81
本期利润	14,031,412.46	30,659,251.29	-50,163,491.10
加权平均基金份额净值	0.0400	0.0676	-0.0884
本期末基金资产净值	5.63%	9.55%	-14.05%
期末可供分配利润	3.83%	13.17%	-5.81%

主要财务指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-72,433,363.88	-147,090,136.36	-180,229,505.98
期末可供分配基金份额净值	-0.2949	-0.3209	-0.3997
期末总资产	173,199,246.31	311,287,275.48	270,635,412.51
期末净资产	0.768	0.679	0.600

主要财务指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-29.56%	-32.10%	-40.00%
期末净资产	-29.56%	-32.10%	-40.00%
期末资产净值	-29.56%	-32.10%	-40.00%

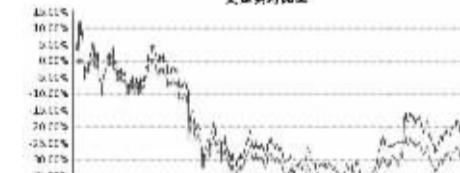
(注)①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；②所述基金份额指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字；③期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和除所列的孰低数。

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	净值增长(%)	业绩比较基准收益率(%)	差额(%)	①	②
过去一个月	-0.56%	-0.47%	-0.09%	-0.00%	-0.00%
过去三个月	-0.59%	-0.54%	-0.05%	-0.04%	-0.04%
过去一年	-3.83%	-6.12%	-2.29%	-0.09%	-0.09%
过去半年	-0.77%	-14.31%	-3.54%	-0.11%	-0.11%
过去一年半	-2.68%	-0.87%	-19.81%	-0.96%	-0.96%
过去三年	-29.56%	-32.10%	-2.54%	-0.21%	-0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率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变动对比图

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)项“投资范围”和(六)项“投资限制”(二)项“投资组合限制”的有关约定。

3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年基金未实施利润分配。

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理的经验

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。公司注册资本1亿元人民币，公司总部设在北京，在深圳、成都、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。

截至2017年12月31日，基金管理人已设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

报告期内，基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金管理业务指引》以及中国证监会相关规定的约定，日常估值由基金经理人与基金经理人一同进行，基金经理人对评估结果负责。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

报告期内，基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金管理业务指引》以及中国证监会相关规定的约定，日常估值由基金经理人与基金经理人一同进行，基金经理人对评估结果负责。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金经理人估值委员会由基金经理人、基金经理助理、基金经理参评加估值专业委员会成员、基金经理人对评估结果负责。

</