

嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）

2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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 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应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	37
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	37

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前所有资产支持证券投资明细	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	37
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	37
7.11 投资组合报告附注.....	38
§ 8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	40
§9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件.....	43
§ 11 备查文件目录	45
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）
基金简称	嘉实原油（QDII-LOF）
场内简称	嘉实原油
基金主代码	160723
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2017 年 4 月 20 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
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	29,915,683.07 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	2017 年 5 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争获得与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争获得与业绩比较基准相似的回报。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	100%WTI 原油价格收益率
风险收益特征	本基金为基金中基金，主要投资于全球范围内的原油主题相关的公募基金（包括 ETF）及公司股票，在证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。 本基金主要投资于境外市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	王永民
	联系电话	(010)65215588	(010)66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	(010)66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京西城区复兴门内大街 1 号

办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100005	100818
法定代表人	赵学军	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	中国银行（香港）有限公司
	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	3,474,658.69
本期利润	5,955,397.85
加权平均基金份额本期利润	0.1992
本期加权平均净值利润率	17.08%
本期基金份额净值增长率	22.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	5,638,358.95
期末可供分配基金份额利润	0.1885
期末基金资产净值	40,404,381.08

期末基金份额净值	1.3506
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	35.06%

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) 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) 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	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
过去一个月	8.43%	1.48%	10.61%	1.87%	-2.18%	-0.39%
过去三个月	18.52%	1.32%	14.18%	1.65%	4.34%	-0.33%
过去六个月	22.59%	1.29%	22.72%	1.56%	-0.13%	-0.27%
过去一年	47.04%	1.17%	61.06%	1.52%	-14.02%	-0.35%
自基金合同生效起至今	35.06%	1.16%	47.01%	1.59%	-11.95%	-0.43%

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

嘉实原油（QDII-LOF）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



图：嘉实原油（QDII-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

（2017 年 4 月 20 日至 2018 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（十三（二）投资范围和（四）投资限制）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 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、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 QDII、特定资产管理业务资格。

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（QDII）、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（QDII-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（QDII-FOF-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（QDII）、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、嘉实中证金边中期国债 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）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票基金、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券。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、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘志刚	本基金基金经理	2017 年 5 月 17 日	—	6 年	曾任巴克莱银行股票研究员。2016 年 2 月加入嘉实国际资产管理有限公司，从事股票研究工作。
蒋一茜	本基金、嘉实海外中国股票混合（QDII）基金经理	2017 年 4 月 20 日	—	20 年	曾任上海申银证券机构销售部及国际部交易员、LG securities (HK) Co., Ltd 研究员、上海沪光国际资产管理（香港）有限公司基金经理助理、德意志资产管理（香港）有限公司基金经理。2009 年 9 月加入嘉实国际资产管理有限公司。硕士研究生，具有基金从业资格，香港国籍。

注：（1）基金经理蒋一茜的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理刘志刚的任职日期指公司作出决定后公告之日；（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

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）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最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

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。

4.3.2 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 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

2018 前六个月，Brent 原油期货价格收于 79.44 美元/桶，较期初价格 66.87 美元/桶上升 18.8%，同比上涨 65.8%；WTI 原油期货价格由期初的 60.42 美元/桶上升 22.7%至 74.15 美元/桶，同比上涨 61.1%。

年初油价随著大市波动，从一月底高位在短时间内下跌 13%。不过从三月开始市场焦点从担心强美元和美国页岩油增产对油价的负面影响，转到原油供给的明显改善。二季度中国和发展中国家需求小幅超预期，美国页岩油出口遇到瓶颈，OPEC 减产因委内瑞拉产量下跌而大幅超预期，和不断升级的中东地缘政治风险，带动油价从 63 美元/桶上升至接近 80 美元/桶的 4 年高位。

二月，全球股市经历大幅下跌与普遍震荡，加之市场对美联储加息的预期增强，美元走高，致使油价承压波动。

委内瑞拉原油产量加速下滑，从去年的 2 百万桶每天，下跌到一月的 1.7 百万桶每天，再下跌到六月底的 1.5 百万桶每天。油价下跌的原因包括巨额债务负担，罢工，恶性通胀和设备故障，而短期内没有解决的方法。市场预计产量还会下跌 0.2 百万桶每天。供给收紧对油价获得一定程度的支撑。

OPEC 减产执行率维持较高水平，增产产量低于预期。维也纳会议之前，OPEC 对减产协议的执行力度较大，平均执行力达到 150%，推动原油市场向再平衡方向发展。6 月 22 日，OPEC 大会宣布成员国回归 100%的减产执行率，即 90 万桶/日的增产目标。然而，会议没有宣布具体增产计划，且该目标低于市场预期。此外，分析人士表示大部分 OPEC 成员国可能不具备在短期内依照此计划提升产量的能力，导致油价在六月先跌后涨。

美国原油库存降低。截至 6 月 22 日，基于美国能源部（DOE）数据的原油库存较一季度末缩减 2%至 41,663.6 万桶，低于 2015 年同期的 43,083.7 万桶；美国原油产量增加 4.2%至 1,090 万桶/日，较一季度的 6.9%增长有所放缓。二季度，美国活跃石油钻机数增加 61 座至 858 座，油气钻机总数增加 54 座至 1047 座。其间，由于内陆运输管道能力掣肘，钻机数增速于五月中旬有

所减缓。

中东局势动荡加剧。二季度，美英法对叙利亚的军事打击使得该地区局势升级，沙特与也门间的冲突也加剧了中东地区的动荡，增加了市场对原油供给不确定性的担忧。继五月单方面退出伊核协议并重启制裁后，美国近期施压相关国家以限制其进口伊朗原油，也为石油供应带来压力。

六月，国际能源署（IEA）微弱下调了其 2018 年全球原油需求的预期至 140 万桶/日，预计下半年需求将随北半球气温回暖有所减弱。同时，IEA 预期非 OPEC 原油产量增幅将达 200 万桶/日。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3506 元；本报告期基金份额净值增长率为 22.59%，业绩比较基准收益率为 22.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 下半年的石油市场风险和波动性将会加剧。其中一个最大的风险是美国即将于 11 月对伊朗实施制裁，使伊朗的石油出口减少约 1 百万桶甚至更多。虽然沙特阿拉伯和俄罗斯提出了通过增加产量来应对供应下降的风险，同时美国愿意在需要时利用国家原油储备去降低油价，可是市场不应低估伊朗制裁的更广泛影响。伊朗威胁受到制裁会封锁霍尔木兹海峡。这是一条关键的石油出口路线，世界上五分一的石油要经过霍尔木兹海峡运输，而封锁对全球供给会带来很大打击。此外，伊朗的制裁可能引发连锁反应，可能会显著提高中东的地缘政治风险和全球石油供应风险。在需求方面，持续的贸易战可能开始削弱全球经济活动和石油需求，而中国处于贸易战的中心，负面影响可能在下半年开始浮现。加上印度的石油需求面临高油价和货币贬值带来的风险，两个石油需求增长国可能下半年失去持续增长的动力。总体而言，我们认为石油供需将在今年年底前会保持紧张，因为 OPEC 愿意通过控制产量将油价维持在 70 美元/桶以上。然而，由于伊朗制裁和需求放缓的影响可能在年底开始浮现而加大油价波动性，到时候建议投资者留意风险。

4.6 管理人对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与基金托管人一同进行，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、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能

力和相关工作经历。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于香港、伦敦和纽约证券交易所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十七（三）基金收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2018-1-1 至 2018-6-30；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情况。

鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境影响，本基金将继续运作。

§ 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”）在嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）（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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,131,237.27	7,155,011.32
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	37,972,995.78	34,537,383.47
其中：股票投资		-	-
基金投资		37,972,995.78	34,537,383.47
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	629.35	79.76
应收股利		-	-
应收申购款		2,055,952.54	27,423.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		43,160,814.94	41,719,897.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,620,350.25	5,716,853.33
应付管理人报酬		29,636.61	39,349.36
应付托管费		8,298.23	11,017.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		9,883.21	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	88,265.56	112,934.03
负债合计		2,756,433.86	5,880,154.57
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	29,915,683.07	32,531,748.89
未分配利润	6.4.7.10	10,488,698.01	3,307,994.42
所有者权益合计		40,404,381.08	35,839,743.31
负债和所有者权益总计		43,160,814.94	41,719,897.88

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3506 元，基金份额总额 29,915,683.07 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 04 月 20 日（基金 合同生效日）至 2017 年 06 月 30 日
一、收入		6,372,617.57	-6,160,747.73
1. 利息收入		9,606.09	143,508.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,606.09	143,508.81
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）		3,853,655.71	-95,698.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	3,853,655.71	-129,043.58
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	33,345.02
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,480,739.16	-5,645,398.28
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-54,174.83	-841,372.88
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	82,791.44	278,213.18
减：二、费用		417,219.72	827,284.50
1. 管理人报酬		172,031.95	286,332.99
2. 托管费		48,168.96	80,173.24
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	84,878.96	417,236.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		13,873.16	-
7. 其他费用	6.4.7.20	98,266.69	43,541.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,955,397.85	-6,988,032.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,955,397.85	-6,988,032.23

注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 20 日，上年度可比期间是指 2017 年 4 月 20 日至 2017 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）	32,531,748.89	3,307,994.42	35,839,743.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	5,955,397.85	5,955,397.85
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）	-2,616,065.82	1,225,305.74	-1,390,760.08
其中：1. 基金申购款	53,445,153.84	10,862,148.92	64,307,302.76
2. 基金赎回款	-56,061,219.66	-9,636,843.18	-65,698,062.84
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）	29,915,683.07	10,488,698.01	40,404,381.08
项目	上年度可比期间 2017 年 04 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 06 月 30 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）	310,422,559.29	-	310,422,559.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-6,988,032.23	-6,988,032.23
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）	-218,563,433.13	-499,666.39	-219,063,099.52
其中：1. 基金申购款	3,810,778.59	-304,932.38	3,505,846.21
2. 基金赎回款	-222,374,211.72	-194,734.01	-222,568,945.73
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）	91,859,126.16	-7,487,698.62	84,371,427.54

注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 20 日，上年度可比期间是指 2017 年 4 月 20 日至 2017 年 6 月 30 日。

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：

经雷

王红

张公允

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 基金基本情况

嘉实原油证券投资基金(QDII-LOF) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”) 证监许可[2016]3046 号《关于准予嘉实原油证券投资基金(QDII-LOF) 注册的批复》核准, 由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实原油证券投资基金(QDII-LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、上市开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 310,382,675.76 元, 业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 普华永道中天验字(2017) 第 334 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《嘉实原油证券投资基金(QDII-LOF) 基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 310,422,559.29 份基金份额, 其中认购资金利息折合 39,883.53 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,

基金托管人为中国银行股份有限公司，境外托管人为中国银行(香港)有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2017]277 号文审核同意，本基金 141,035,535.00 份基金份额于 2017 年 5 月 5 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实原油证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》的有关规定，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公开募集证券投资基金(以下简称“公募基金”，包含交易型开放式基金 ETF)；普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；金融衍生产品(远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品)、结构性投资产品(与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性产品)以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金为基金中的基金(FOF)，投资于公募基金的比例不低于基金资产的 80%。本基金以原油主题投资为主，投资于原油主题相关的基金的比例不低于本基金非现金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：100%WTI 原油价格收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实原油证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的其他收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	3,131,237.27
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—

存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	3,131,237.27

注：定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	31,064,548.08	37,972,995.78	6,908,447.70
其他	-	-	-
合计	31,064,548.08	37,972,995.78	6,908,447.70

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	614.08
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	15.27
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	629.35

6.4.7.6 其他资产

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

6.4.7.7 应付交易费用

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,287.97
预提费用	80,977.59
合计	88,265.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,531,748.89	32,531,748.89
本期申购	53,445,153.84	53,445,153.84
本期赎回（以“-”号填列）	-56,061,219.66	-56,061,219.66
本期末	29,915,683.07	29,915,683.07

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,629,771.76	1,678,222.66	3,307,994.42
本期利润	3,474,658.69	2,480,739.16	5,955,397.85
本期基金份额交易产生的变动数	533,928.50	691,377.24	1,225,305.74
其中：基金申购款	7,053,625.29	3,808,523.63	10,862,148.92
基金赎回款	-6,519,696.79	-3,117,146.39	-9,636,843.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,638,358.95	4,850,339.06	10,488,698.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,278.96
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	327.13
合计	9,606.09

6.4.7.12 股票投资收益

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	31,820,701.05
减：卖出/赎回基金成本总额	27,851,435.66
减：基金投资收益应缴纳增值税额	115,609.68
基金投资收益	3,853,655.71

6.4.7.14 债券投资收益

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,480,739.16
股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	2,480,739.16
贵金属投资	-

其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	2,480,739.16

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	82,791.44
其他	—
合计	82,791.44

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	84,878.96
银行间市场交易费用	—
合计	84,878.96

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	16,512.63
银行划款手续费	17,289.10
上市年费	29,752.78
合计	98,266.69

6.4.7.21 汇兑收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
汇兑收益	-54,174.83
合计	-54,174.83

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国银行（香港）有限公司	基金托管人的子公司、境外资产托管人
德意志证券亚洲有限公司	与基金管理人股东处于同一控股集团

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本期(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日)及上年度可比期间(2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日)，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本期(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日)及上年度可比期间(2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日)，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本期(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日)及上年度可比期间(2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日)，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 04 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
德意志证券亚洲有限公司	9,254,470.24	15.26	-	-

注：上年度可比期间(2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日)，本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本期(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日)及上年度可比期间(2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日),本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总 额的比例 (%)
德意志证券亚洲有限公司	700.21	0.83	-	-

注 1: 上年度可比期间(2017 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日), 本基金无应支付关联方佣金。

注 2: 上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 04 月 20 日(基金合 同生效日) 至 2017 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	172,031.95	286,332.99
其中: 支付销售机构的客户维护费	34,288.04	341.47

注: 支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金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: 日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 04 月 20 日(基金合 同生效日) 至 2017 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	48,168.96	80,173.24

注: 支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.28%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: 日基金托管费=前一日基金资产净值×0.28%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2017 年 04 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2017 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日），基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.10.4.2 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（2018 年 6 月 30 日）及上年度末（2017 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 04 月 20 日(基金合同生效日) 至 2017 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	3,117,553.08	9,278.96	2,588,845.90	143,462.85
中国银行（香港）有限公司_活期	13,684.19	-	2,752,419.89	-

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2017 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2018 年 06 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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（2018 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2018 年 6 月 30 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为基金中基金，主要投资于全球范围内的原油主题相关的公募基金（包括 ETF）及公司股票，在证券投资基金中属于较高预期风险和预期收益的基金品种。本基金主要投资于境外市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争获得与业绩比较基准相似的回报。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在境内和境外托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有债券投资(上年度末：无)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性

风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。每只境外基金投资比例不超过本基金基金资产净值的 20%。本基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金所持基金部分在证券交易所上市，其余亦可在场外赎回，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,131,237.27			-	3,131,237.27
结算备付金	-			-	-
存出保证金	-			-	-
交易性金融资产	-			37,972,995.78	37,972,995.78
衍生金融资产	-			-	-
买入返售金融资产	-			-	-
应收证券清算款	-			-	-
应收利息	-			629.35	629.35
应收股利	-			-	-
应收申购款	192,187.98			1,863,764.56	2,055,952.54
递延所得税资产	-			-	-
其他资产	-			-	-
资产总计	3,323,425.25	-	-	39,837,389.69	43,160,814.94
负债					
短期借款	-			-	-
交易性金融负债	-			-	-
衍生金融负债	-			-	-
卖出回购金融资产款	-			-	-
应付证券清算款	-			-	-
应付赎回款	-			2,620,350.25	2,620,350.25
应付管理人报酬	-			29,636.61	29,636.61
应付托管费	-			8,298.23	8,298.23
应付销售服务费	-			-	-
应付交易费用	-			-	-
应交税费	-			9,883.21	9,883.21
应付利息	-			-	-
应付利润	-			-	-
递延所得税负债	-			-	-
其他负债	-			88,265.56	88,265.56
负债总计	-	-	-	2,756,433.86	2,756,433.86
利率敏感度缺口	3,323,425.25	-	-	37,080,955.83	40,404,381.08
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,155,011.32			-	7,155,011.32
结算备付金	-			-	-

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	34,537,383.47	34,537,383.47
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	79.76	79.76
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	5,093.18	-	22,330.15	27,423.33
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	7,160,104.50	-	34,559,793.38	41,719,897.88
负债	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	5,716,853.33	5,716,853.33
应付管理人报酬	-	-	39,349.36	39,349.36
应付托管费	-	-	11,017.85	11,017.85
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	112,934.03	112,934.03
负债总计	-	-	5,880,154.57	5,880,154.57
利率敏感度缺口	7,160,104.50	-	-28,679,638.81	35,839,743.31

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 年 12 月 31 日：无）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2017 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理

人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币 元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	13,975.98	-	-	13,975.98
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	36,855,571.27	1,117,424.51	-	37,972,995.78
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	36,869,547.25	1,117,424.51	-	37,986,971.76
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-

资产负债表 外汇风险敞 口净额	36,869,547.25	1,117,424.51	-	37,986,971.76
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币 元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	7,025,974.61	-	-	7,025,974.61
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融 资产	31,891,628.01	2,645,755.46	-	34,537,383.47
衍生金融资 产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清 算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	38,917,602.62	2,645,755.46	-	41,563,358.08
以外币计价的 负债				
应付证券清 算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服 务费	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞	38,917,602.62	2,645,755.46	-	41,563,358.08

口净额				
-----	--	--	--	--

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	1,899,348.59	2,078,167.90
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,899,348.59	-2,078,167.90

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以原油主题投资为主，投资于原油主题相关的基金的比例不低于本基金非现金资产的80%，原油主题相关基金主要包括以跟踪原油价格指数或原油价格为投资目标的公募基金（包含ETF）。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例（%）	公允价值	占基金资产 净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	—	—	—	—
交易性金融资产—基金投资	37,972,995.78	93.98	34,537,383.47	96.37
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—

其他	-	-	-	-
合计	37,972,995.78	93.98	34,537,383.47	96.37

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	1,441,728.65	-
	业绩比较基准下降 5%	-1,441,728.65	-

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 37,972,995.78 元，无属于第二、第三层次的余额（上年度末：第一层次 34,537,383.47 元，无属于第二、第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间

及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	—	—
	其中：普通股	—	—
	存托凭证	—	—
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	37,972,995.78	87.98
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
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	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	3,131,237.27	7.25
8	其他各项资产	2,056,581.89	4.76
9	合计	43,160,814.94	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

报告期末，本基金未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

报告期末，本基金未持有权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

报告期末，本基金未持有权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益明细

报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未进行权益投资交易。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益明细

报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未进行权益投资交易。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未进行权益投资交易。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前所有资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

报告期末，本基金未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	UNITED STATES OIL FUND LP	ETF 基金	交易型开放式	United States Commodities Fu	7,307,638.76	18.09

				nd LLC		
2	UNITED STATES BRENT OIL FUND	ETF 基金	交易型开放式	United States Commodities Fund LLC	7,230,677.38	17.90
3	ETFS BRENT 1MTH OIL	ETC 基金	交易型开放式	ETF Securities Management Co Ltd	6,565,237.98	16.25
4	POWERSHARES DB OIL FUND	ETF 基金	交易型开放式	Deutsche Bank AG	6,260,131.87	15.49
5	ETFS WTI CRUDE OIL	ETC 基金	交易型开放式	ETF Securities Management Co Ltd	5,537,452.59	13.71
6	UNITED STATES 12 MONTH OIL	ETF 基金	交易型开放式	United States Commodities Fund LLC	3,954,432.69	9.79
7	SAMSUNG S&P GSCI CR ET F-HKD	ETF 基金	交易型开放式	Samsung Asset Management Hong Kong Ltd	1,117,424.51	2.77

注:报告期末, 本基金仅持有上述 7 只基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查, 在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.11.2

本基金投资的前十名股票中, 没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	629.35
5	应收申购款	2,055,952.54

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,056,581.89

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
12,300	2,432.17	—	—	29,915,683.07	100.00

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	安峻岐	391,026.00	9.44
2	田浩	299,510.00	7.23
3	邵常红	258,634.00	6.24
4	袁东文	200,009.00	4.83
5	肖责华	189,228.00	4.57
6	邓凤章	130,000.00	3.14
7	徐忠民	101,100.00	2.44
8	崔银宝	100,003.00	2.41
9	欧明成	100,000.00	2.41
10	肖舒月	100,000.00	2.41

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	99,348.08	0.33

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 4 月 20 日）基金份额总额	310,422,559.29
本报告期期初基金份额总额	32,531,748.89
本报告期基金总申购份额	53,445,153.84
减：本报告期基金总赎回份额	56,061,219.66
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	29,915,683.07

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2018 年 3 月 21 日本基金管理人发布公告，经雷先生任公司总经理，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞银证券亚洲有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	-	-	42,153.86	50.02%	-
摩根大通证券（亚太）有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	13,446.42	15.96%	-
德意志证券亚洲有限公司 Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	700.21	0.83%	新增
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	11,911.42	14.13%	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	7,490.30	8.89%	-
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	5,070.18	6.02%	-
高盛（亚洲）有限责任公司	-	-	-	3,501.18	4.15%	-

Goldman Sachs (Asia) L.L.C						
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	-	-	-	-	-
美林（亚太）有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-

注:1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
瑞银证券亚洲有限公司 UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	28,621,380.85	47.21%
摩根大通证券（亚太）有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	9,673,579.32	15.96%

德意志证券亚洲有限公司 Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	9,254,470.24	15.26%
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	5,579,724.49	9.20%
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-	3,389,941.10	5.59%
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	2,357,326.59	3.89%
高盛（亚洲）有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	-	1,750,587.30	2.89%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于嘉实原油（QDII-LOF）2018 年 1 月 15 日暂停申购、赎回业务的公告	证券日报、管理人网站	2018 年 1 月 11 日
2	嘉实基金管理有限公司关于增加万得基金为嘉实原油等证券投资基金代销机构的公告	证券日报、管理人网站	2018 年 2 月 23 日
3	关于修改嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）基金合同及托管协议的公告	证券日报、管理人网站	2018 年 3 月 22 日
4	嘉实基金管理有限公司关于调整旗下部分基金赎回费的公告	证券日报、管理人网站	2018 年 3 月 22 日
5	关于嘉实原油（QDII-LOF）2018 年 3 月 30 日、4 月 2 日暂停申购、赎回业务公告	证券日报、管理人网站	2018 年 3 月 28 日
6	嘉实基金管理有限公司关于嘉实原油（QDII-LOF）2018 年 5 月 7 日暂停申购、赎回业务公告	证券日报、管理人网站	2018 年 5 月 3 日
7	嘉实基金管理有限公司关于嘉实原油（QDII-LOF）2018 年 5 月 22 日暂停申购、赎回业务公告	证券日报、管理人网站	2018 年 5 月 18 日
8	嘉实基金管理有限公司关于嘉实原油（QDII-LOF）2018 年 5 月 28 日暂停	证券日报、管理人网站	2018 年 5 月 24 日

	申购、赎回业务公告		
9	关于增加上海挖财基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	证券日报、管理人网站	2018 年 5 月 25 日
10	关于增加天天基金等为嘉实原油代销机构并参加费率优惠的公告	证券日报、管理人网站	2018 年 5 月 25 日
11	关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为旗下基金代销机构的公告	证券日报、管理人网站	2018 年 5 月 28 日
12	嘉实基金管理有限公司关于嘉实原油（QDII-LOF）2018 年 7 月 2 日暂停申购、赎回业务公告	证券日报、管理人网站	2018 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）注册的批复文件；
- (2) 《嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》；
- (3) 《嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）托管协议》；
- (4) 《嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实原油证券投资基金（QDII-LOF）公告的各项原稿。

11.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2018 年 8 月 25 日