

嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)

[2011] 第一季度报告

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
报告送出日期:2011年4月22日

\$重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2011年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期间自2011年1月1日起至2011年3月31日止。

\$2 基金产品概况

基金简称	嘉实基本面50指数(LOF)(深交所上市简称:嘉实50)
交易主代码	160716
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月30日
报告期末基金份额总额	3,012,790,540.34份
投资目标	采用量化化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金管理人严格按照指数编制规则，按标的指数的成份股及其权重构造股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证锐联基本面50指数×95%+银行同业存款收益率×5%
风险收益特征	本基金属采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益水平低于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较低风险、较高收益产品。
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

\$3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标	单位:人民币元			
主要财务指标	报告期(2011年1月1日 - 2011年3月31日)			
1.本期已实现收益	-25,836,889.58			
2.本期利润	100,092,007.37			
3.加权平均基金份额本期利润	0.0400			
4.期末基金份额净值	2,356,286,290.25			
5.期末基金份额净值	0.7821			
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。				
3.2 基金净值表现				
3.2.1 本基金报告期内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 率(%)	净值增长 率标准差(%)	业绩比较基 准收益率(%)	业绩比较基 准收益率标准差(%)
过去三个月	5.85%	1.12%	6.32%	1.13%
	-	-	-0.47%	-0.01%
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:嘉实基本面50指数 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图(2009年12月30日至2011年3月31日)				

注:按基金合同和招募说明约定，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(十一、二、基金投资范围和(七、基金投资组合限制)的有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理 钱晓东基金经理小组简介	单位:人民币元			
姓名	任本基金的基金经理期限			
杨阳	任职日期 2009年12月30日 离任日期 -			
本基金基金经理	11年			
注:①任职日期是指本基金基金合同生效之日起;②本基金从行业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定。				
②管理人对拟任期内本基金运作遵循《证券法》、《证券投资基金法》及其他各项配套法规、《关于促进基金行业健康发展的指导意见》、《证券投资基金评价办法》等法律法规的规定，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 公平交易专项说明				
4.3.1 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证监会、证券投资基金业协会公平交易制度指导原则及公司内部公平交易制度，公平对待所有客户，不存在影响公平交易的现象。				
4.3.2 本基金未发生内幕交易、利用未公开信息交易的情况。				
4.3.3 异常交易行为的专项说明				
报告期内，本基金未发生异常交易行为。				
4.4 报告期内本基金的投资策略及业绩表现的说明				
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析				
报告期内，本基金因宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望				
本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。				
4.4.2 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证监会、证券投资基金业协会公平交易制度指导原则及公司内部公平交易制度，公平对待所有客户，不存在影响公平交易的现象。				
4.4.3 本基金未发生内幕交易、利用未公开信息交易的情况。				
4.4.4 报告期内本基金的投资策略和运作分析				
报告期内，本基金因宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望				
本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。				
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望				
本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。				
4.6 投资组合报告				
4.6.1 报告期内基金资产组合情况				
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)	
1	权益投资	2,304,968,412.57	90.40	
2	固定收益投资	2,304,968,412.57	90.40	
3	货币市场基金	49,650,000.00	2.04	
4	其他资产	49,650,000.00	2.04	
5	合计	2,356,286,290.25	100.00	
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。				
3.2.2 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:嘉实基本面50指数 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图(2009年1月1日至2011年3月31日)				

注:按基金合同和招募说明约定，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(十一、二、基金投资范围和(七、基金投资组合限制)的有关规定。

4.7 公平交易专项说明

4.7.1 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证监会、证券投资基金业协会公平交易制度指导原则及公司内部公平交易制度，公平对待所有客户，不存在影响公平交易的现象。

4.7.2 本基金未发生内幕交易、利用未公开信息交易的情况。

4.7.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.7.4 报告期内本基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金因宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.7.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.8 其他需要说明的事项

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.9 证券投资对宏观经济、证券市场、行业走势的简要展望

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.10 基金投资对行业的影响分析

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.11 公司内部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证监会、证券投资基金业协会公平交易制度指导原则及公司内部公平交易制度，公平对待所有客户，不存在影响公平交易的现象。

4.12 本基金未发生内幕交易、利用未公开信息交易的情况。

4.13 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.14 报告期内本基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金因宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.15 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.16 其他需要说明的事项

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.17 公平交易专项说明

4.17.1 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证监会、证券投资基金业协会公平交易制度指导原则及公司内部公平交易制度，公平对待所有客户，不存在影响公平交易的现象。

4.17.2 本基金未发生内幕交易、利用未公开信息交易的情况。

4.17.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.17.4 报告期内本基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金因宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.17.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.17.6 其他需要说明的事项

本基金基于对宏观经济、证券市场及行业走势的判断，本基金将根据宏观政策和基金合同的约定，适时调整投资组合的配置比例。

4.17.7 公平交易专项说明

4.17.8 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证监会、证券投资基金业协会公平交易制度指导原则及公司内部公平交易制度，公平对待所有客户，不存在影响公平交易的现象。