

嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)

2019年第二季度报告

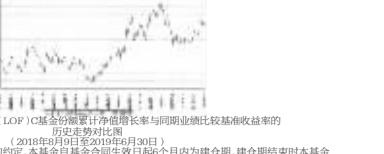


图2:嘉实基本面50指数(LOF)成立以来的净值走势(单位:%)

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之日起6个月内为建仓期,建仓结束时本基金的各投资比例均符合基金合同(三)投资限制和(七)投资组合的有关约定。

本基金的财务资料和净值表现。

报告日期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金类型:股票型开放式基金

基金简称:嘉实基本面50指数(LOF)

基金代码:160718

上市交易方式:上市开放式基金(LOF)

基金合同生效日:2009年12月31日

报告期末基金资产总额:1,401,197,470.49份

投资目标:运用数理的投资模型,通过严谨的投资纪律和数据化的风险管理手

法,精选出具有投资价值的公司,为投资者创造长期稳定的回报。

投资策略:本基金在充分分析和研究的基础上,精选出具有投资价值的公司,并根据其投资价值和投资风险,对本基金的投资组合进行动态的调整。

业绩基准:中证基本面50指数收益率×95%+银行同期存款基准收益率×5%

风险收益特征:本基金主要投资于数据化操作的绩优股票,其收益的波动和收益高

于货币市场基金,风险收益特征介于股票型基金、为证券投资基金中的较高风险、

高收益特征。

本基金的财务资料和净值表现。

报告日期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期2019年4月1日-2019年6月30日 报告期2019年4月1日-2019年6月30日

总资产 51,022,490,410.00 50,779,550.00

总负债 3,424,300,364.00 322,614.00

净资产 47,598,189,846.00 50,779,550.00

基金份额净值 1.0505 1.0204

报告期利润 1,000,114.00

期末可供分配利润 6,727,607.86 6,727,607.86

注:由于C类基金份额只开通境外份额,在境内"嘉实500"不是严格意义的"内地场内",而是指基金在交易所交易的境外份额。

§ 3.1 主要财务指标

报告期2019年4月1日-2019年6月30日

报告期2019年4月1日-2019年6月3