

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

2011年3月31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
重要提示:基金管理人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...

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期利润总额 25,836,889.38
2.本期净利润 100,092,007.37

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

3.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
注:本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票等...

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

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对比图

图:嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金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

4.1 基金经理 魏巍基金经理小组 简介
姓名 魏巍 职务 本基金基金经理
4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况

5.4 投资组合报告
5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
5.4.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
报告期末,本基金未持有股票投资

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券投资

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
报告期末,本基金未持有股票投资

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券投资

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

2011 第一季度报告

2011年3月31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
重要提示:基金管理人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...

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期利润总额 77,776,617.29
2.本期净利润 62,807,223.83

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

3.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
注:本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票等...

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

图:嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金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:嘉实价值优势股票型证券投资基金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

4.1 基金经理 魏巍基金经理小组 简介
姓名 魏巍 职务 本基金基金经理
4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况

5.4 投资组合报告
5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
5.4.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
报告期末,本基金未持有股票投资

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券投资

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
报告期末,本基金未持有股票投资

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
报告期末,本基金未持有债券投资

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

嘉实价值优势股票型证券投资基金

2011 第一季度报告

2011年3月31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
重要提示:基金管理人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...

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期利润总额 131,216,103.00
2.本期净利润 151,615,758.21

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

3.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
注:本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票等...

5.4 投资组合报告
5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
5.4.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

图:嘉实价值优势股票型证券投资基金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:嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金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