

嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金名称:嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)
基金代码:160720
基金运作方式:上市开放式基金(LOF)

主要财务指标
报告期末总资产 164,037,096.53元
报告期末基金份额总额 1,164,037,096.53份
本报告期末基金份额净值 1.4133元

投资策略
本基金为被动式指数基金,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力求基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,半年跟踪误差不得超过4%。

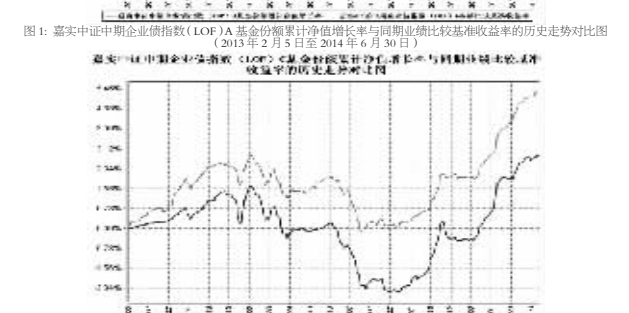


图1:嘉实中证中期企业债指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

基金经理:曹宇
曹宇先生,现任嘉实基金管理有限公司基金经理,负责嘉实中证中期企业债指数(LOF)基金的投资管理工作。

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金名称:嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)
基金代码:160720

主要财务指标
报告期末总资产 121,101,808.55元
报告期末基金份额总额 1,121,101,808.55份
本报告期末基金份额净值 1.0802元

投资策略
本基金为被动式指数基金,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力求基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%,半年跟踪误差不得超过3%。



图1:嘉实中证中期企业债指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

4.2 管理人对于报告期内本基金资产净值波动情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其各项配套法规,《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 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,各投资组合按照相同的投资流程和投资决策,并在获得投资建议、投资建议和实际投资决策方面享有公平的机会。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。



图1:嘉实中证中期企业债指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

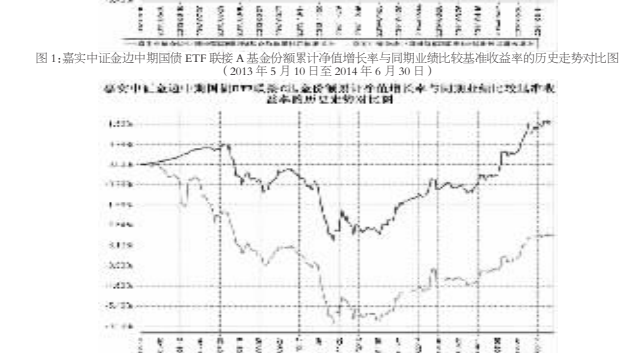


图1:嘉实中证中期企业债指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

图1:嘉实中证中期企业债指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金名称:嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)
基金代码:160716
基金运作方式:上市开放式基金(LOF)

主要财务指标
报告期末总资产 1,389,013,542.61元
报告期末基金份额总额 1,389,013,542.61份
本报告期末基金份额净值 1.0092元

投资策略
本基金为被动式指数基金,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力求基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%,半年跟踪误差不得超过4%。



图1:嘉实中证锐联基本面50指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

4.2 管理人对于报告期内本基金资产净值波动情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其各项配套法规,《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 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,各投资组合按照相同的投资流程和投资决策,并在获得投资建议、投资建议和实际投资决策方面享有公平的机会。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。



图1:嘉实中证锐联基本面50指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

图1:嘉实中证锐联基本面50指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

Table with columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

图1:嘉实中证锐联基本面50指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

图1:嘉实中证锐联基本面50指数(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金名称:嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金代码:160723
基金运作方式:上市开放式基金(LOF)

主要财务指标
报告期末总资产 121,101,808.55元
报告期末基金份额总额 1,121,101,808.55份
本报告期末基金份额净值 1.0802元

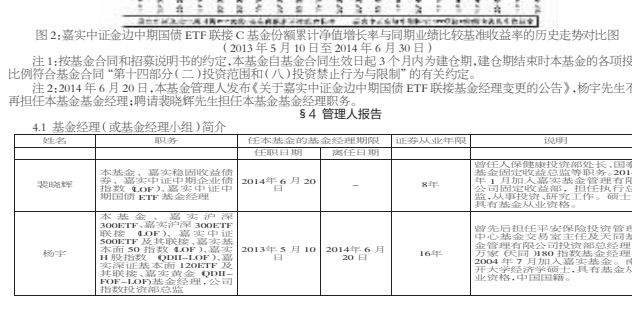


图1:嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

4.2 管理人对于报告期内本基金资产净值波动情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》及其各项配套法规,《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 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,各投资组合按照相同的投资流程和投资决策,并在获得投资建议、投资建议和实际投资决策方面享有公平的机会。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内,本基金管理人严格执行了《基金合同中中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《基金招募说明书》及其各项配套法规,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

图1:嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

图1:嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

图1:嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图