

**嘉实泰和混合型证券投资基金
(原泰和证券投资基金转型)
2014 年半年度报告**

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 20 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。

嘉实泰和混合型证券投资基金由泰和证券投资基金转型而成。依据中国证监会《关于泰和证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]148 号）生效的泰和证券投资基金基金份额持有人大会决议，泰和证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“嘉实泰和混合型证券投资基金”。自 2014 年 4 月 4 日起，由《泰和证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》生效。

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。

嘉实泰和混合型证券投资基金报告期自 2014 年 4 月 4 日起至 2014 年 6 月 30 日止，原泰和证券投资基金报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 4 月 3 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（转型前）.....	5
2.1 基金基本情况（转型后）.....	5
2.2 基金产品说明（转型前）.....	5
2.2 基金产品说明（转型后）.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现（转型前）.....	8
3.2 基金净值表现（转型后）.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	15
6.1 资产负债表(转型前).....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	34
6.1 资产负债表（转型后）.....	34
6.2 利润表.....	35
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	36
6.4 报表附注.....	37
§7 投资组合报告(转型前)	56
7.1 期末基金资产组合情况.....	56
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 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	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
7.8 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贵金属投资明细	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§7 投资组合报告(转型后)	62
7.1 期末基金资产组合情况	62
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	62
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	63
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 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	67
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
7.8 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贵金属投资明细	67
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息(转型前)	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末上市基金前十名持有人	68
§8 基金份额持有人信息(转型后)	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
8.3 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的情况	69
§9 开放式基金份额变动	69
§10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)	72
10.8 其他重大事件 (转型后)	73
10.8 其他重大事件 (转型前)	74
§11 备查文件目录	75
11.1 备查文件目录	75
11.2 存放地点	75
11.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	泰和证券投资基金
基金简称	嘉实泰和封闭
场内简称	基金泰和
基金主代码	500002
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 4 月 8 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00 份
基金合同存续期	15 年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999-04-20

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	嘉实泰和混合型证券投资基金
基金简称	嘉实泰和混合
基金主代码	000595
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 4 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,668,106,376.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金采用“自上而下”的资产配置与“自下而上”的股票选择相结合的投资方法。在综合宏观经济发展情况、政策取向、证券市场走势等多种因素的基础上,确定基金在股票、国债上的投资比例。坚持以基本分析为基础,重视数量分析,系统考察上市公司的投资价值,最终确定所投资的股票,并以技术分析辅助个股投资的时机选择。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	分享中国改革与发展成果,密切跟踪中国经济发展背景下产业转移、格局变迁、主题带动和企业成长的投资机会,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要参考公司股票投资决策委员会形成的大类

	资产配置建议,综合考虑宏观经济因素、资本市场因素、主要大类资产的相对估值等因素,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数×70%+上证国债指数×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	田青
	联系电话	(010) 65215588	(010) 67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010) 67595096
传真		(010) 65182266	(010) 66275853
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100005	100033
法定代表人		安奎	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司(转型后) 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司(转型前)	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层(转型后) 上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 36 楼(转型前)

§ 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	转型前	转型后
	报告期(2014年1月1日-2014年4月3日(基金合同终止日))	报告期(2014年4月4日(基金合同生效日)-2014年6月30日)
本期已实现收益	63,886,481.08	42,301,780.10
本期利润	-105,520,402.87	177,661,414.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0528	0.0722
本期加权平均净值利润率	-4.12%	7.10%
本期基金份额净值增长率	-4.56%	7.16%
3.1.2 期末数据和指标	基金合同终止日(2014年4月3日)	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	63,843,038.00	126,686,992.78
期末可供分配基金份额利润	0.0319	0.0475
期末基金资产净值	2,078,496,185.83	2,809,201,806.72
期末基金份额净值	1.0392	1.053
3.1.3 累计期末指标	基金合同终止日(2014年4月3日)	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	926.78%	7.16%

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) 所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。

(4) 本基金已于 2014 年 4 月 30 日对原泰和证券投资基金退市时的基金份额进行了折算，基金折算比例为 1:1.057531085。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

转型前						
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	0.00%	0.00%				
过去三个月	-0.35%	0.00%				
过去六个月	-4.56%	2.01%				
过去一年	11.45%	2.14%				
过去三年	22.84%	2.13%				
自基金合同生效起至今	926.78%	2.69%				

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：嘉实泰和封闭累计份额净值增长率的历史走势对比图

（1999年4月8日至2014年4月3日）

注 1：报告期内，本基金的各项投资比例符合基金合同（七、（四）投资组合）的有关约定：（1）本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；（2）本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值 10%；本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；（3）遵守中国证监会规定的其他比例限制。

注 2：本基金自 2014 年 4 月 4 日起，由《泰和证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》生效，原《泰和证券投资基金基金合同》同日起失效。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

转型后						
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	5.41%	0.76%	0.39%	0.55%	5.02%	0.21%
自基金合同生效起至今	7.16%	0.79%	0.36%	0.62%	6.80%	0.17%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×70%+上证国债指数×30%。

采用该业绩比较基准主要基于：①沪深 300 指数和上证国债指数编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性和权威性；②作为混合型基金，选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

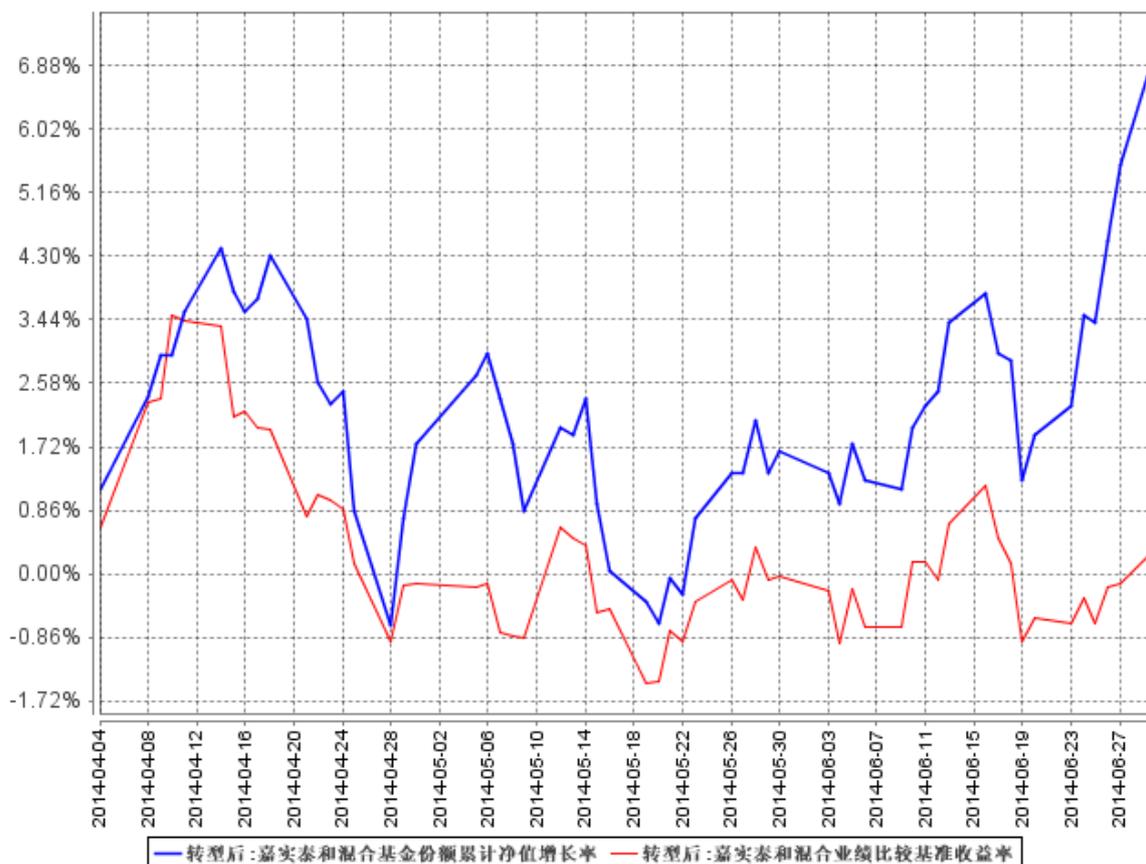
$$\text{Return}(t) = 70\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 30\% \times (\text{上证国债指数}(t) / \text{上证国债指数}(t-1) - 1)$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

3.2.2 自基金转型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

嘉实泰和混合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：嘉实泰和混合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

(2014 年 4 月 4 日至 2014 年 6 月 30 日)

注 1：本基金转型日期为 2014 年 4 月 4 日，本基金基金合同生效日 2014 年 4 月 4 日至报告期末未 1 年。

注 2：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，本报告期处于建仓期内。

§ 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 2014 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、62 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、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、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票 (QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、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、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利股票、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、嘉实新兴市场双币分级债券、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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券等证券投资基金。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（转型前）

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		
张弢	本基金、嘉实研究精选股票基金经理	2013 年 6 月 19 日	2014 年 4 月 3 日	11 年	曾任兴安证券有限责任公司金融工程分析师、行业分析师、投资经理。2005 年 9 月加盟嘉实基金管理有限公司，任行业分析师，曾任社保组合基金经理、嘉实增长混合、嘉实策略混合基金经理。经济学硕士，CFA，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1) 任职日期是指公司作出决定后公告之日，离任日期是指原泰和证券投资基金基金合同终止之日；(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。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
张弢	本基金、嘉实研究精选股票基金经理	2014年4月4日	-	11年	曾任兴安证券有限责任公司金融工程分析师、行业分析师、投资经理。2005年9月加盟嘉实基金管理有限公司，任行业分析师，曾任社保组合基金经理、嘉实增长混合、嘉实策略混合基金经理。经济学硕士，CFA，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1) 任职日期是指本基金基金合同生效之日；(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合规守信情况的说明

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、《泰和证券投资基金基金合同》、《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》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 3 次，均为旗下 ETF 因被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易，但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

1 季度宏观经济数据继续疲软，实体经济流动性持续较为紧张，部分大宗商品价格波动较大。政策基调日益清晰，市场化的调结构成为政府的取向，部分政策在区域和行业小试牛刀，但由于总量性政策匮乏，短期经济的下滑迹象难以扭转。违约事件开始出现，短期拉动资金价格，但长期有利于整体社会资金成本的降低。伴随着经济的下滑，开始出现稳增长的迹象和声音，市场开始憧憬政府在铁路、环保等基建和结构调整方面有所动作。

2 季度银行间资金状况有了明显改善，但实体经济的资金依然较为紧张，政府通过各种定向宽松给经济注入流动性，又极力避免全局性放水的指引或者暗示。投资人对于长期经济前景日益悲观，期待出清或者刺激的破局。另外，创业板再融资放开，较低的发行价吸引了大量的资金参与 IPO。在以上的背景下，市场大盘指数基本稳定，小幅波动，投资人追逐经济疲软背景下的转型机会和政府主导的投资方向。

14 年上半年，本基金淡化仓位选择，维持中等偏高的仓位，以泛消费为主题配置，并投资了农业、军工、移动互联网等板块。1 季度业绩较落后，2 季度由于重仓股表现突出，取得了较好的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）泰和封闭份额净值为 1.0392 元，本报告期（自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 4 月 3 日止）基金份额净值增长率为-4.56%。

截至本报告期末泰和混合份额净值为 1.053 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.16%，业绩比较基准收益率为 0.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 14 年下半年，资金成本可能继续分化，实体经济的资金水平仍将维持高位，经济复苏的迹象不会清晰，政策的着力点判断依然在改革和转型方面，传统投资链条的机会不大。当然，由于市场上已经有了政府稳经济的声音。同时，另一方面，伴随着沪港通的推进，市场整体的估值体系有重新均衡的机会，低估值价值股将会迎来较好的表现时机。

因此，下半年的股票市场的机会可能较为多元，除了代表未来方向的新经济依然会有所表现外，传统投资链条的机会也将迎来阶段性行情。

基于对经济复苏力度的判断，本基金将淡化大盘选择，以股票中等偏高仓位作为资产配置的选择方向。板块上，以大消费作为基金主力配置品种。同时，基金将重点关注农业、移动互联网等行业投资机会。

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、季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、监察稽核等部门负责人组成，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验。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上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金转型前，基金管理人于 2014 年 3 月 19 日发布《泰和证券投资基金 2013 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2013 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 2.486 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”；转型后，嘉实泰和混合基金合同生效日 2014 年 4 月 4 日至报告期末不满 3 个月。报告期内本基金利润分配，符合基金合同的约定。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内本基金实施利润分配的金额为 497,200,000.85 元。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型前)

6.1 资产负债表(转型前)

会计主体：泰和证券投资基金

报告截止日：2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 4 月 3 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,700,491.45	82,363,868.12
结算备付金		2,550,363.10	2,423,537.25
存出保证金		620,353.49	757,856.14
交易性金融资产	6.4.7.2	2,063,756,064.23	2,588,457,110.66
其中：股票投资		1,622,285,062.32	2,013,981,508.32
基金投资		-	-
债券投资		441,471,001.91	574,475,602.34
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		-	7,627,879.47
应收利息	6.4.7.5	11,710,055.88	14,277,151.87
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,443,826.29	-
资产总计		2,085,781,154.44	2,695,907,403.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 4 月 3 日	上年度末 2013 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		3,847,975.03	7,989,974.27
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		258,284.74	3,369,225.02
应付托管费		43,047.45	561,537.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,499,915.09	1,151,247.72
应交税费		968,829.46	968,829.46
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	666,916.84	650,000.00
负债合计		7,284,968.61	14,690,813.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	78,496,185.83	681,216,589.55
所有者权益合计		2,078,496,185.83	2,681,216,589.55
负债和所有者权益总计		2,085,781,154.44	2,695,907,403.51

注：本基金合同终止日为 2014 年 4 月 3 日，本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至基金合同终止日 2014 年 4 月 3 日止，报告截止日 2014 年 4 月 3 日，基金份额净值 1.0392 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：泰和证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-90,673,492.00	321,658,802.27
1. 利息收入		5,479,086.16	7,950,566.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	255,298.83	792,886.23
债券利息收入		5,223,787.33	7,126,045.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	31,634.84
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		73,254,305.79	414,567,389.12

其中：股票投资收益	6.4.7.12	72,769,793.54	404,633,557.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	497,864.36	123,270.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-13,352.11	9,810,561.55
3. 公允价值变动收益	6.4.7.16	-169,406,883.95	-100,859,153.39
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		14,846,910.87	28,161,069.06
1. 管理人报酬		9,930,496.76	16,151,508.66
2. 托管费		1,655,082.80	2,691,918.05
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,965,217.44	9,077,394.15
5. 利息支出		24,234.25	-
其中：卖出回购金融资产支出		24,234.25	-
6. 其他费用	6.4.7.19	271,879.62	240,248.20
三、利润总额		-105,520,402.87	293,497,733.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-105,520,402.87	293,497,733.21

注：本基金合同终止日为 2014 年 4 月 3 日，本期是指 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日，上年度可比期间是指 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰和证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 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）	2,000,000,000.00	681,216,589.55	2,681,216,589.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-105,520,402.87	-105,520,402.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人	-	-497,200,000.85	-497,200,000.85

分配利润产生的基金净值变动			
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	78,496,185.83	2,078,496,185.83
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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）	2,000,000,000.00	2,454,643.99	2,002,454,643.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	678,761,945.56	678,761,945.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	681,216,589.55	2,681,216,589.55

注：本基金合同终止日为 2014 年 4 月 3 日，本期是指 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日，上年度可比期间是指 2013 年 1 月 1 日至 2013 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：

赵学军

李松林

王红

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

泰和证券投资基金(以下简称“本基金”)由嘉实基金管理有限公司、广发证券股份有限公司、北京证券有限责任公司、中诚信托有限责任公司和吉林省信托投资有限责任公司五家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《泰和证券投资基金基金合同》发起，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[1999]7号文批准，于1999年4月8日募集成立。本基金为契约型封闭式，存续期为15年，发行规模为20亿份基金份额。

本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字(99)第19号文审核同意，于1999年4月20日在上交所挂牌交易。根据中国证监会证监基金字[1999]7号文的有关规定，本基金的投资

范围为国内依法发行、上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。

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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰和证券投资基金基金合同》和中国证监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

本基金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 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）止期间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

本基金在本报告期间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、中国证监会财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (2) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所

得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(3) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）
活期存款	5,700,491.45
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,700,491.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,609,251,739.55	1,622,285,062.32	13,033,322.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,359,000.00	1,493,001.91
	银行间市场	438,492,176.85	439,978,000.00
	合计	439,851,176.85	441,471,001.91
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,049,102,916.40	2,063,756,064.23	14,653,147.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）），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（2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）），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（2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）），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 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）
应收活期存款利息	22,189.49
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	2,528.51
应收债券利息	11,684,928.64
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	409.24
合计	11,710,055.88

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）
其他应收款	-
待摊费用	1,443,826.29
合计	1,443,826.29

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）
交易所市场应付交易费用	1,497,265.09
银行间市场应付交易费用	2,650.00
合计	1,499,915.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	250,000.00
预提费用	416,916.84
合计	666,916.84

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年4月3日（基金合同终止日）	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回	-	-
本期末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00

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	497,156,557.77	184,060,031.78	681,216,589.55
本期利润	63,886,481.08	-169,406,883.95	-105,520,402.87
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-497,200,000.85	-	-497,200,000.85
本期末	63,843,038.00	14,653,147.83	78,496,185.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年4月3日（基金合同终止日）
	活期存款利息收入
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	12,545.17
其他	2,608.35
合计	255,298.83

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年4月3日（基金合同终止日）
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	1,142,967,822.12
买卖股票差价收入	72,769,793.54

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年4月3日(基金合同终止日)
卖出债券及债券到期兑付成交金额	366,027,876.69
减: 卖出债券及债券到期兑付成本总额	354,784,015.64
减: 应收利息总额	10,745,996.69
债券投资收益	497,864.36

6.4.7.14 衍生工具收益

本期(2014年1月1日至2014年4月3日(基金合同终止日)), 本基金无其他收入。

6.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年4月3日(基金合同终止日)
股票投资产生的股利收益	-13,352.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	-13,352.11

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年4月3日(基金合同终止日)
1. 交易性金融资产	-169,406,883.95
——股票投资	-171,928,019.16
——债券投资	2,521,135.21
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-169,406,883.95

6.4.7.17 其他收入

本期(2014年1月1日至2014年4月3日(基金合同终止日)), 本基金无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年4月3日(基金合同终止日)
交易所市场交易费用	2,962,867.44
银行间市场交易费用	2,350.00
合计	2,965,217.44

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日(基金合同终止日)
审计费用	25,479.21
信息披露费	76,437.63
红利手续费	47,773.71
其他	100,400.00
上市费	15,000.00
银行费用	2,289.07
账户维护费	4,500.00
合计	271,879.62

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 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日），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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日））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、基金发起人
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）	基金托管人

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

本期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日））及上年度可比期间（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

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	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,930,496.76	16,151,508.66
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	-	-

注 1：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。如果由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的 20%，超过部分不计提基金管理人报酬。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

注 2：报告期自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,655,082.80	2,691,918.05

注 1：基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

注 2：报告期自 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）。

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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日））及上年度可比期间（2013 年 1 月 1 日至 2013 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	15,858,600.00	15,858,600.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	15,858,600.00	15,858,600.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.79%	0.79%

注：基金管理人作为本基金发起人，于本基金 1999 年 4 月 2 日发行日认购本基金份额 10,000,000 份，每份发行价格为 1.01 元，其中：面值为 1.00 元；发行费用为 0.01 元；通过二级市场买入本基金基金份额 5,858,600 份，交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
中诚信托有 限责任公司	6,250,000.00	0.31%	6,250,000.00	0.31%
立信投资有 限责任公司	6,250,000.00	0.31%	6,250,000.00	0.31%
广发证券股 份有限公司	6,250,000.00	0.31%	6,250,000.00	0.31%

注：（1）中诚信托有限责任公司（原中煤信托投资有限责任公司）、广发证券股份有限公司作为本基金发起人，于本基金 1999 年 4 月 2 日发行日分别认购本基金份额 12,500,000 份，每份发行价格为 1.01 元，其中：面值为 1.00 元；发行费用为 0.01 元。截止 2013 年 12 月 31 日，中诚信托有限责任公司、广发证券股份有限公司均持有本基金 6,250,000 份。

（2）吉林省信托投资有限责任公司作为本基金发起人，其持有的本基金 6,250,000 份转让给立信投资有限责任公司，于 2005 年 8 月 23 日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理完过户手续。

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	5,700,491.45	240,145.31	147,440,812.55	752,536.51

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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（2014年1月1日至2014年4月3日（基金合同终止日））及上年度可比期间（2013年1月1日至2013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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2014年3月24日	2014年3月25日	-	2.4860	497,200,000.85	-	497,200,000.85	注：2013年年度收益分配于2014年实施
合计	-	-	-	2.4860	497,200,000.85	-	497,200,000.85	

6.4.12 期末（2014年4月3日（基金合同终止日））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（2014年4月3日（基金合同终止日）），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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600587	新华医疗	2014年2月18日	重大事项停牌	84.56	2014年4月21日	83.87	177,953	5,486,550.28	15,047,705.68	-

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（2014年4月3日（基金合同终止日）），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（2014年4月3日（基金合同终止日）），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

本基金为进行主动投资的股票型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

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 workflows、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行合约责任，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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业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 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日），本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券公允价值占基金资产净值的比例为 0.07%（2013 年 12 月 31 日：0.05%）。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日），本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2014年4月3日 (基金合同终止日)	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,700,491.45	-	-	-	5,700,491.45
结算备付金	2,550,363.10	-	-	-	2,550,363.10
存出保证金	620,353.49	-	-	-	620,353.49
交易性金融资产	440,942,147.80	-	528,854.11	1,622,285,062.32	2,063,756,064.23
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	-	-	-	11,710,055.88	11,710,055.88
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,443,826.29	1,443,826.29
资产总计	449,813,355.84	-	528,854.11	1,635,438,944.49	2,085,781,154.44
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	-	-	-	3,847,975.03	3,847,975.03
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	258,284.74	258,284.74
应付托管费	-	-	-	43,047.45	43,047.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,499,915.09	1,499,915.09

应交税费	-	-	-	968,829.46	968,829.46
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	666,916.84	666,916.84
负债总计	-	-	-	7,284,968.61	7,284,968.61
利率敏感度缺口	449,813,355.84	-	528,854.11	1,628,153,975.88	2,078,496,185.83
上年度末 2013 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	82,363,868.12	-	-	-	82,363,868.12
结算备付金	2,423,537.25	-	-	-	2,423,537.25
存出保证金	757,856.14	-	-	-	757,856.14
交易性金融资产	573,953,516.40	-	522,085.94	2,013,981,508.32	2,588,457,110.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	7,627,879.47	7,627,879.47
应收利息	-	-	-	14,277,151.87	14,277,151.87
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	659,498,777.91	-	522,085.94	2,035,886,539.66	2,695,907,403.51
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	-	-	-	7,989,974.27	7,989,974.27
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,369,225.02	3,369,225.02
应付托管费	-	-	-	561,537.49	561,537.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,151,247.72	1,151,247.72
应交税费	-	-	-	968,829.46	968,829.46
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	650,000.00	650,000.00
负债总计	-	-	-	14,690,813.96	14,690,813.96
利率敏感度缺口	659,498,777.91	-	522,085.94	2,021,195,725.70	2,681,216,589.55

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

假设	除市场利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（2014年4月3日 （基金合同终止日））	上年度末（2013年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	306,669.83	363,104.17
	市场利率上升 25 个基点	-306,010.02	-362,122.91

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本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和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票、债券的投资比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。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 2014年4月3日（基金合同终止日）		上年度末 2013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	1,622,285,062.32	78.05	2,013,981,508.32	75.11

资				
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	1,622,285,062.32	78.05	2,013,981,508.32	75.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日））	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	71,115,157.41	65,061,732.50
	沪深 300 指数下降 5%	-71,115,157.41	-65,061,732.50

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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 4 月 3 日，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级的余额为 1,608,730,358.55 元，属于第二层级的余额为 455,025,705.68 元，无属于第

三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级 2,030,731,110.66 元，第二层级 557,726,000.00 元，无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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，本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的公允价值列入第一层级；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级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）(转型后)

6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：嘉实泰和混合型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	174,726,415.13
结算备付金		4,728,751.45
存出保证金		650,608.49
交易性金融资产	6.4.7.2	2,663,746,725.08
其中：股票投资		2,392,066,932.26
基金投资		-
债券投资		271,679,792.82
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	9,423,062.25
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.6	976,706.45
资产总计		2,854,252,268.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30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		38,706,352.02
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,315,931.35
应付托管费		552,655.22
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,043,339.80
应交税费		968,829.46
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	463,354.28
负债合计		45,050,462.13
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	2,522,957,873.04
未分配利润	6.4.7.10	286,243,933.68
所有者权益合计		2,809,201,806.72
负债和所有者权益总计		2,854,252,268.85

注:本基金合同生效日为 2014 年 4 月 4 日,本报告期自基金合同生效日 2014 年 4 月 4 日起至 2014 年 6 月 30 日止,报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.005 元,基金份额总额 2,330,159,322.58 份。

6.2 利润表

会计主体: 嘉实泰和混合

本报告期: 2014 年 4 月 4 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2014年4月4日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
一、收入		190,415,742.46
1. 利息收入		3,521,088.78
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	509,094.59
债券利息收入		3,011,994.19

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		51,535,016.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	28,757,187.18
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	602,296.48
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	22,175,533.18
3. 公允价值变动收益	6.4.7.16	135,359,634.03
4. 汇兑收益		-
5. 其他收入	6.4.7.17	2.81
减：二、费用		12,754,328.33
1. 管理人报酬		9,057,814.03
2. 托管费		1,509,635.66
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,612,207.86
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	574,670.78
三、利润总额		177,661,414.13
减：所得税费用		-
四、净利润		177,661,414.13

注：本基金合同生效日为 2014 年 4 月 4 日，本期是指 2014 年 4 月 4 日至 2014 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实泰和混合

本报告期：2014 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2014 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）	2,000,000,000.00	78,496,185.83	2,078,496,185.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	177,661,414.13	177,661,414.13
三、本期基金份额交易产生的基	522,957,873.04	30,086,333.72	553,044,206.76

金净值变动数			
其中：1. 基金申购款	522,957,873.04	30,086,333.72	553,044,206.76
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,522,957,873.04	286,243,933.68	2,809,201,806.72

注：本基金合同生效日为 2014 年 4 月 4 日，本期是指 2014 年 4 月 4 日至 2014 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

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：

_____ 赵学军	_____ 李松林	_____ 王红
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

嘉实泰和混合型证券投资基金是根据原泰和证券投资基金(以下简称“基金泰和”)基金份额持有人大会 2014 年 2 月 27 日决议通过的《关于泰和证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)基金部函[2014] 148 号《关于泰和证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》，由原基金泰和转型而来。原基金泰和为契约型封闭式基金，于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市，存续期限至 2014 年 4 月 4 日止。根据上海证券交易所[2014] 134 号《关于终止泰和证券投资基金上市的决定》，基金泰和于 2014 年 4 月 3 日进行终止上市权利登记。自 2014 年 4 月 4 日起，基金泰和终止上市，基金泰和更名为泰和混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《泰和证券投资基金基金合同》失效的同时《泰和混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

基金泰和于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 2,078,496,185.83 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《泰和混合型证券投资基金招募说明书》和《嘉实泰和混合型证券投资基金集中申购结果暨原泰和证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2014 年 4 月 30 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 1.057531085，并于 2014 年 4 月 30 日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2014 年 4 月 8 日至 2014 年 4 月 28 日期间内开放集中申购，共募集 553,044,206.76 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 172,665.21 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(2014)第 231 号审验报告予以验证。

上述集中申购募集资金已按 2014 年 4 月 30 日基金份额折算后的基金份额净值 1.000 元折合为 553,044,206.76 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 172,665.21 份基金份额，并于 2014 年 4 月 30 日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰和混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，股指期货、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×70%+上证国债指数×30%。

根据《泰和混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资组合应在基金成立 6 个月内达到基金合同规定的比例限制。截至 2014 年 6 月 30 日止，本基金尚处于建仓期。

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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰和混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监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

本基金 2014 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日止期间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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2014年6月30日
活期存款	174,726,415.13
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	174,726,415.13

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	2,243,280,469.89	2,392,066,932.26	148,786,462.37
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	1,359,000.00	1,489,792.82	130,792.82
	银行间市场	269,094,473.33	270,190,000.00	1,095,526.67
	合计	270,453,473.33	271,679,792.82	1,226,319.49
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,513,733,943.22	2,663,746,725.08	150,012,781.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2014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（2014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（2014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 2014年6月30日
应收活期存款利息	40,717.96
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	2,128.76
应收债券利息	9,379,922.83
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	292.70
合计	9,423,062.25

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	976,706.45
合计	976,706.45

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,043,339.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,043,339.80

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	250,000.00
预提费用	213,354.28
合计	463,354.28

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年4月4日（基金合同生效日）至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
- 基金份额折算调整	115,062,169.51	-
- 未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	553,044,206.76	522,957,873.04
- 基金拆分和集中申购完成后	2,668,106,376.27	2,522,957,873.04
本期申购	-	-
本期赎回	-	-
本期末	2,668,106,376.27	2,522,957,873.04

注 1：根据《嘉实泰和混合型证券投资基金招募说明书》和《嘉实泰和混合型证券投资基金集中申购结果暨原泰和证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，2014 年 4 月 30 日为原泰和证券投资基金的基金份额折算基准日，经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算前基金份额净值为 1.058 元，精确到小数点后第 9 位为 1.057531085 元（第 10 位舍去），本基金管理人按照 1.057531085 的折算比例对原泰和证券投资基金进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为 1.000 元，折算后的基金份额为折算前的基金份额乘以折算比例，采用循环进位法保留到小数点后两位。折算前原泰和证券投资基金份额总额为 20 亿份，折算后基金份额总额为

2,115,062,169.51 份。

注 2: 本基金于 2014 年 4 月 8 日至 2014 年 4 月 28 日向社会公开募集, 截至 2014 年 4 月 30 日止, 募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 552,871,541.55 元, 在募集期间产生的活期存款利息为人民币 172,665.21 元, 以上实收基金合计 553,044,206.76 元, 折合为 553,044,206.76 份嘉实泰和混合型证券投资基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

金额单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	63,843,038.00	14,653,147.83	78,496,185.83
本期利润	42,301,780.10	135,359,634.03	177,661,414.13
本期基金份额交易产生的变动数	20,542,174.68	9,544,159.04	30,086,333.72
其中: 基金申购款	20,542,174.68	9,544,159.04	30,086,333.72
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	126,686,992.78	159,556,940.90	286,243,933.68

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2014 年 4 月 4 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	494,713.35
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	11,954.17
其他	2,427.07
合计	509,094.59

6.4.7.12 股票投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 4 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	425,407,467.70
减: 卖出股票成本总额	396,650,280.52
买卖股票差价收入	28,757,187.18

6.4.7.13 债券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 2014 年 4 月 4 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
债券到期兑付金额	175,317,000.00

减：债券到期兑付成本总额	169,397,703.52
减：应收利息总额	5,317,000.00
债券投资收益	602,296.48

6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2014年4月4日（基金合同生效日）至2014年6月30日），本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月4日（基金合同生效日）至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	22,175,533.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	22,175,533.18

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年4月4日（基金合同生效日）至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	135,359,634.03
——股票投资	135,753,139.60
——债券投资	-393,505.57
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	135,359,634.03

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月4日（基金合同生效日）至2014年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	2.81
合计	2.81

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月4日（基金合同生效日）至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,612,207.86
银行间市场交易费用	-

合计	1,612,207.86
----	--------------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年4月4日(基金合同生效日)至2014年6月30日
审计费用	24,109.36
信息披露费	72,328.08
红利手续费	467,119.84
其他	1,000.00
银行费用	5,613.50
账户维护费	4,500.00
合计	574,670.78

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

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期间的关联方交易

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

本期（2014年4月4日（基金合同生效日）至2014年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

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
----	----

	2014 年 4 月 4 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,057,814.03
其中：支付销售机构的客户维护费	704,264.66

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

	本期 2014 年 4 月 4 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,509,635.66

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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（2014 年 4 月 4 日（基金合同生效日）至 2014 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

份额单位：份

	本期 2014 年 4 月 4 日至 2014 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	16,770,962.46
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	16,770,962.46
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.63%

注：2014 年 6 月 4 日因确权增加份额 16,770,962.46 份，无费用。

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（2014 年 6 月 30 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

	本期 2014 年 4 月 4 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
关联方名称	

	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	174,726,415.13	494,713.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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（2014年4月4日（基金合同生效日）至2014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（2014年4月4日（基金合同生效日）至2014年6月30日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2014年6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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
603369	今世缘	2014年6月25日	2014年7月3日	未上市	16.93	16.93	5,360	90,744.80	90,744.80

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

本期末（2014年6月30日），本基金未持有流通受限的债券。

6.4.12.1.3 受限证券类别：其他

本期末（2014年6月30日），本基金未持有流通受限的其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002100	天康生物	2014年5月27日	重大事项停牌	9.82	未知	未知	2,845,796	32,621,961.90	27,945,716.72	-
601012	隆基股份	2014年6月19日	重大事项停牌	15.50	2014年7月1日	15.60	4,900	66,484.00	75,950.00	-

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（2014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（2014 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

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于债券基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，谋求基金资产的长期稳定增值。

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 workflows、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行合约责任，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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业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 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.05%。

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随时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每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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2014 年 6 月 30 日, 本基金所承担的其他/全部金融负债的合同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/约为未折现的合约到期现金流量。

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主要为银行存款、结算备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位: 人民币元

本期末 2014 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	174,726,415.13	-	-	-	174,726,415.13
结算备付金	4,728,751.45	-	-	-	4,728,751.45
存出保证金	650,608.49	-	-	-	650,608.49
交易性金融资产	271,121,585.60	-	558,207.22	2,392,066,932.26	2,663,746,725.08
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	-	-	-	9,423,062.25	9,423,062.25
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	976,706.45	976,706.45

资产总计	451,227,360.67	-	558,207.22	2,402,466,700.96	2,854,252,268.85
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				38,706,352.02	38,706,352.02
应付赎回款					
应付管理人报酬				3,315,931.35	3,315,931.35
应付托管费				552,655.22	552,655.22
应付销售服务费					
应付交易费用				1,043,339.80	1,043,339.80
应交税费				968,829.46	968,829.46
应付利息					
应付利润					
递延所得税负债					
其他负债				463,354.28	463,354.28
负债总计				45,050,462.13	45,050,462.13
利率敏感度缺口	451,227,360.67	-	558,207.22	2,357,416,238.83	2,809,201,806.72

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 9.67%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本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和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金

管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的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%。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 2014 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,392,066,932.26	85.15
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	2,392,066,932.26	85.15

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2014 年 6 月 30 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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 日，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级的余额为 2,365,535,058.36 元，属于第二层级的余额为 298,211,666.72 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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，本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的公允价值列入第一层级；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级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，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(转型前)

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	1,622,285,062.32	77.78
	其中：股票	1,622,285,062.32	77.78
2	固定收益投资	441,471,001.91	21.17
	其中：债券	441,471,001.91	21.17
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	8,250,854.55	0.40
7	其他资产	13,774,235.66	0.66

合计	2,085,781,154.44	100.00
----	------------------	--------

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	158,872,951.94	7.64
B	采矿业	-	-
C	制造业	956,445,633.28	46.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,807,790.84	0.71
F	批发和零售业	173,342,004.74	8.34
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	283,738,286.90	13.65
J	金融业	27,681,054.00	1.33
K	房地产业	1,052,273.92	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,345,066.70	0.31
S	综合	-	-
	合计	1,622,285,062.32	78.05

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600315	上海家化	6,105,823	208,147,506.07	10.01
2	300017	网宿科技	1,663,821	164,984,490.36	7.94
3	600079	人福医药	4,695,259	126,725,040.41	6.10
4	000333	美的集团	1,907,434	87,932,707.40	4.23
5	000998	隆平高科	3,781,749	87,131,496.96	4.19
6	600050	中国联通	27,374,498	84,039,708.86	4.04
7	600887	伊利股份	2,190,592	78,861,312.00	3.79
8	601933	永辉超市	5,930,321	73,951,102.87	3.56
9	300037	新宙邦	2,298,785	72,664,593.85	3.50

10	002299	圣农发展	6,618,464	61,022,238.08	2.94
11	000963	华东医药	1,050,111	44,094,160.89	2.12
12	000895	双汇发展	1,082,153	41,771,105.80	2.01
13	000651	格力电器	1,462,592	40,806,316.80	1.96
14	300224	正海磁材	2,310,399	40,385,774.52	1.94
15	600525	长园集团	3,201,617	32,624,477.23	1.57
16	000028	国药一致	726,300	31,775,625.00	1.53
17	000001	平安银行	2,570,200	27,681,054.00	1.33
18	300265	通光线缆	1,301,252	26,766,753.64	1.29
19	000876	新希望	2,200,707	25,792,286.04	1.24
20	600697	欧亚集团	1,445,674	23,521,115.98	1.13
21	000970	中科三环	1,726,712	22,602,660.08	1.09
22	002100	天康生物	2,163,045	20,765,232.00	1.00
23	300113	顺网科技	401,902	19,612,817.60	0.94
24	002020	京新药业	1,228,947	18,766,020.69	0.90
25	002124	天邦股份	2,013,055	17,433,056.30	0.84
26	002311	海大集团	1,816,880	17,423,879.20	0.84
27	002157	正邦科技	2,605,090	15,630,540.00	0.75
28	600587	新华医疗	177,953	15,047,705.68	0.72
29	002051	中工国际	816,306	14,807,790.84	0.71
30	002410	广联达	398,956	14,506,040.16	0.70
31	000625	长安汽车	1,274,200	12,894,904.00	0.62
32	600884	杉杉股份	770,387	12,187,522.34	0.59
33	002041	登海种业	368,865	10,719,216.90	0.52
34	002446	盛路通信	321,412	9,099,173.72	0.44
35	600612	老凤祥	283,123	6,588,272.21	0.32
36	300133	华策影视	253,195	6,345,066.70	0.31
37	600563	法拉电子	177,590	4,461,060.80	0.21
38	600649	城投控股	147,584	1,052,273.92	0.05
39	002349	精华制药	53,675	896,372.50	0.04
40	002253	川大智胜	24,637	595,229.92	0.03
41	300101	国腾电子	8,400	171,360.00	0.01

注：2014年4月3日，本基金持有的“上海家化”股票市值因该股上涨被动超过基金资产净值10%，4月10日已调整至10%以下。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600050	中国联通	100,514,860.42	3.75
2	300017	网宿科技	90,027,614.89	3.36
3	600418	江淮汽车	61,603,154.77	2.30
4	600315	上海家化	51,258,608.26	1.91
5	300037	新宙邦	49,699,750.42	1.85
6	300224	正海磁材	41,887,862.64	1.56
7	000001	平安银行	40,361,969.51	1.51
8	600525	长园集团	36,975,328.87	1.38
9	000970	中科三环	28,714,835.00	1.07
10	000423	东阿阿胶	26,674,547.44	0.99
11	300265	通光线缆	24,163,930.55	0.90
12	002104	恒宝股份	21,836,647.49	0.81
13	600079	人福医药	21,034,977.30	0.78
14	600066	宇通客车	20,821,004.21	0.78
15	000963	华东医药	19,271,036.88	0.72
16	600884	杉杉股份	16,760,332.52	0.63
17	601933	永辉超市	15,651,317.26	0.58
18	300113	顺网科技	15,357,526.68	0.57
19	002410	广联达	15,096,283.40	0.56
20	600869	远东电缆	13,661,871.14	0.51

7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600718	东软集团	109,011,346.58	4.07
2	600418	江淮汽车	67,528,982.27	2.52
3	300017	网宿科技	62,497,696.05	2.33
4	600827	友谊股份	57,050,754.91	2.13
5	000895	双汇发展	50,003,223.74	1.86
6	002603	以岭药业	45,510,347.77	1.70
7	600887	伊利股份	42,320,135.02	1.58
8	000333	美的集团	39,560,806.93	1.48
9	300003	乐普医疗	36,981,493.67	1.38
10	300113	顺网科技	33,866,770.26	1.26

11	000876	新希望	33,698,246.26	1.26
12	000651	格力电器	32,529,885.80	1.21
13	601607	上海医药	26,963,759.96	1.01
14	601888	中国国旅	26,676,058.66	0.99
15	600079	人福医药	24,540,157.56	0.92
16	000423	东阿阿胶	23,959,030.28	0.89
17	002100	天康生物	22,418,388.49	0.84
18	600612	老凤祥	21,933,385.96	0.82
19	002299	圣农发展	21,809,899.33	0.81
20	601933	永辉超市	20,895,297.90	0.78

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	923,199,395.28
卖出股票收入（成交）总额	1,215,737,615.66

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	50,216,000.00	2.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	389,762,000.00	18.75
	其中：政策性金融债	389,762,000.00	18.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,493,001.91	0.07
8	其他	-	-
	合计	441,471,001.91	21.24

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130218	13 国开 18	1,300,000	130,000,000.00	6.25
2	130236	13 国开 36	800,000	79,920,000.00	3.85
3	130322	13 进出 22	500,000	49,995,000.00	2.41

4	130314	13 进出 14	500,000	49,945,000.00	2.40
5	130022	13 付息国债 22	400,000	40,216,000.00	1.93

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日），本基金未持有资产支持证券。

7.8 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贵金属投资明细

2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日），本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日），本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）），本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日）），本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 上海家化联合股份有限公司发布了《关于收到中国证监会〈调查通知书〉的公告》，因公司涉嫌违反《中华人民共和国证券法》及相关法规，中国证监会决定对公司立案稽查。本基金投资于“上海家化(600315)”的决策程序说明：基于上海家化基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“上海家化”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无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中，其他九名证券发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	620,353.49
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	11,710,055.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	1,443,826.29
8	其他	-
	合计	13,774,235.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110007	博汇转债	964,147.80	0.05
2	128003	华天转债	528,854.11	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

2014 年 4 月 3 日（基金合同终止日），本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 7 投资组合报告(转型后)

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	2,392,066,932.26	83.81
	其中：股票	2,392,066,932.26	83.81
2	固定收益投资	271,679,792.82	9.52
	其中：债券	271,679,792.82	9.52
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	179,455,166.58	6.29
7	其他资产	11,050,377.19	0.39
	合计	2,854,252,268.85	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	331,691,200.57	11.81

B	采矿业	-	-
C	制造业	1,321,104,876.54	47.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	393,253,918.40	14.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,290,000.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,692,752.89	8.28
J	金融业	44,846,937.28	1.60
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	51,586,267.67	1.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,600,978.91	0.56
S	综合	-	-
	合计	2,392,066,932.26	85.15

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600315	上海家化	6,312,969	231,370,313.85	8.24
2	601933	永辉超市	26,991,469	170,586,084.08	6.07
3	000963	华东医药	2,738,528	147,880,512.00	5.26
4	000998	隆平高科	5,336,382	146,643,777.36	5.22
5	002299	圣农发展	12,608,564	146,133,256.76	5.20
6	600079	人福医药	4,695,259	140,153,481.15	4.99
7	300017	网宿科技	2,114,897	134,930,428.60	4.80
8	000333	美的集团	5,657,988	109,312,328.16	3.89
9	600050	中国联通	29,164,728	94,202,071.44	3.35
10	600887	伊利股份	2,094,894	69,382,889.28	2.47
11	000651	格力电器	2,083,237	61,351,329.65	2.18
12	300224	正海磁材	2,643,685	60,963,376.10	2.17
13	600557	康缘药业	1,911,525	54,860,767.50	1.95
14	000895	双汇发展	1,465,407	52,446,916.53	1.87
15	000028	国药一致	1,286,052	51,377,777.40	1.83
16	000069	华侨城A	10,777,043	50,544,331.67	1.80

17	000625	长安汽车	4,026,134	49,561,709.54	1.76
18	600525	长园集团	4,319,854	47,691,188.16	1.70
19	000876	新希望	4,209,281	47,522,782.49	1.69
20	002311	海大集团	4,280,550	47,128,855.50	1.68
21	600276	恒瑞医药	1,225,455	40,636,087.80	1.45
22	002714	牧原股份	883,409	38,914,166.45	1.39
23	300203	聚光科技	2,360,093	37,525,478.70	1.34
24	600855	航天长峰	1,719,504	29,437,908.48	1.05
25	002583	海能达	1,067,034	29,087,346.84	1.04
26	002100	天康生物	2,845,796	27,945,716.72	0.99
27	300265	通光线缆	1,301,252	27,131,104.20	0.97
28	600990	四创电子	924,647	25,048,687.23	0.89
29	000901	航天科技	1,430,926	23,109,454.90	0.82
30	002020	京新药业	1,228,947	22,121,046.00	0.79
31	000001	平安银行	2,185,591	21,659,206.81	0.77
32	600697	欧亚集团	1,149,890	20,514,037.60	0.73
33	002157	正邦科技	2,605,090	19,251,615.10	0.69
34	601601	中国太保	1,072,137	19,073,317.23	0.68
35	002124	天邦股份	2,013,055	17,735,014.55	0.63
36	600184	光电股份	779,729	16,452,281.90	0.59
37	300291	华录百纳	444,599	15,600,978.91	0.56
38	600562	国睿科技	168,121	9,002,879.55	0.32
39	600523	贵航股份	572,099	7,740,499.47	0.28
40	601566	九牧王	584,798	6,163,770.92	0.22
41	000999	华润三九	244,131	4,489,569.09	0.16
42	601318	中国平安	104,586	4,114,413.24	0.15
43	002253	川大智胜	136,587	3,407,845.65	0.12
44	000026	飞亚达A	353,974	2,895,507.32	0.10
45	002572	索菲亚	155,526	2,556,847.44	0.09
46	002216	三全食品	94,400	1,703,920.00	0.06
47	600009	上海机场	100,000	1,290,000.00	0.05
48	300144	宋城演艺	39,200	1,041,936.00	0.04
49	002349	精华制药	53,675	990,840.50	0.04
50	300005	探路者	36,863	569,164.72	0.02
51	300101	振芯科技	8,400	190,008.00	0.01
52	002726	龙大肉食	10,024	171,009.44	0.01
53	300386	飞天诚信	2,640	152,407.20	0.01
54	300385	雪浪环境	3,963	101,690.58	0.00
55	603369	今世缘	5,360	90,744.80	0.00

56	601012	隆基股份	4,900	75,950.00	0.00
57	603006	黎明股份	2,119	30,301.70	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601933	永辉超市	96,245,041.10	3.43
2	000963	华东医药	77,485,066.44	2.76
3	002299	圣农发展	65,712,489.02	2.34
4	000069	华侨城 A	61,060,527.75	2.17
5	600557	康缘药业	53,126,238.30	1.89
6	000333	美的集团	41,519,436.38	1.48
7	000998	隆平高科	39,304,996.24	1.40
8	600276	恒瑞医药	37,420,347.54	1.33
9	300203	聚光科技	36,212,227.94	1.29
10	002714	牧原股份	33,557,365.43	1.19
11	000625	长安汽车	33,394,322.37	1.19
12	002583	海能达	28,476,666.96	1.01
13	000876	新希望	28,222,252.61	1.00
14	002311	海大集团	26,487,045.66	0.94
15	600855	航天长峰	25,776,738.89	0.92
16	600990	四创电子	22,775,763.48	0.81
17	000028	国药一致	21,705,840.01	0.77
18	300017	网宿科技	20,875,392.66	0.74
19	000402	金融街	20,858,275.92	0.74
20	000901	航天科技	20,652,852.17	0.74

7.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300017	网宿科技	86,248,228.63	3.07
2	300037	新宙邦	60,392,415.65	2.15
3	000970	中科三环	29,449,094.01	1.05
4	000333	美的集团	25,983,059.80	0.92

5	300113	顺网科技	23,157,125.99	0.82
6	000402	金融街	18,928,322.74	0.67
7	600887	伊利股份	17,556,337.90	0.62
8	600587	新华医疗	14,994,808.69	0.53
9	002051	中工国际	14,561,571.41	0.52
10	000001	平安银行	13,273,261.28	0.47
11	002410	广联达	12,486,893.78	0.44
12	600884	杉杉股份	11,959,808.11	0.43
13	002041	登海种业	10,673,523.54	0.38
14	000026	飞亚达A	9,631,911.29	0.34
15	000069	华侨城A	9,335,071.58	0.33
16	600050	中国联通	8,380,798.46	0.30
17	600612	老凤祥	6,638,107.32	0.24
18	300133	华策影视	6,491,889.62	0.23
19	002446	盛路通信	6,010,220.24	0.21
20	600325	华发股份	5,471,616.37	0.19

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,030,679,010.86
卖出股票收入（成交）总额	425,407,467.70

注：7.4.1项“买入金额”、7.4.2项“卖出金额”及7.4.3项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	40,100,000.00	1.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,090,000.00	8.19
	其中：政策性金融债	230,090,000.00	8.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,489,792.82	0.05
8	其他	-	-
	合计	271,679,792.82	9.67

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130236	13 国开 36	800,000	80,016,000.00	2.85
2	130322	13 进出 22	500,000	50,035,000.00	1.78
3	130314	13 进出 14	500,000	49,995,000.00	1.78
4	130022	13 付息国债 22	400,000	40,100,000.00	1.43
5	130243	13 国开 43	400,000	40,044,000.00	1.43

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

7.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

(1) 上海家化联合股份有限公司发布了《关于收到中国证监会〈调查通知书〉的公告》，因公司涉嫌违反《中华人民共和国证券法》及相关法规，中国证监会决定对公司立案稽查。本基金投资于“上海家化(600315)”的决策程序说明：基于上海家化基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“上海家化”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无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中，其他九名证券发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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。**7.12.3 其他资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	650,608.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,423,062.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	976,706.45
8	其他	-
	合计	11,050,377.19

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110007	博汇转债	931,585.60	0.03
2	128003	华天转债	558,207.22	0.02

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息(转型前)

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
40,930	48,863.91	1,248,301,464.00	62.42%	751,698,536.00	37.58%

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	中国人寿保险(集团)公司	218,704,126.00	10.94%
2	中国人寿保险股份有限公司	199,930,545.00	10.00%
3	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人 分红—019L—FH002 沪	134,466,350.00	6.72%
4	中国平安人寿保险股份有限公司—分红— 银保分红	61,000,001.00	3.05%
5	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产	52,751,435.00	2.64%

	品		
6	中国人寿再保险股份有限公司	37,560,505.00	1.88%
7	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	34,894,413.00	1.74%
8	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	31,033,402.00	1.55%
9	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	30,396,655.00	1.52%
10	宝钢集团有限公司	30,000,000.00	1.50%

注：上表数据由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供。

§ 8 基金份额持有人信息(转型后)

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
14,507	183,918.55	1,087,775,237.68	40.77%	1,580,331,138.59	59.23%

8.2 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	66,225.26	0.00%

8.3 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的情况

本期末，基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年4月4日）基金份额总额	2,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	553,044,206.76
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	115,062,169.51
报告期期末基金份额总额	2,668,106,376.27

注：报告期间基金总申购份额含封转开集中申购基金份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

泰和证券投资基金于 2014 年 2 月 27 日以现场方式在北京召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于泰和证券投资基金转型有关事项的议案》。基金管理人已于 2014 年 3 月 17 日收到中国证监会《关于泰和证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]148 号，此次基金份额持有人大会决议报中国证监会备案手续完成。

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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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

根据泰和证券投资基金基金份额持有人大会决议，泰和证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，并调整了投资目标、范围和策略。自 2014 年 4 月 4 日起，由《泰和证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》生效。

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 (转型后)

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
招商证券股份 有限公司	1	662,531,167.10	45.51%	463,775.08	45.51%	-
宏源证券股份 有限公司	1	320,964,213.11	22.05%	224,674.93	22.05%	-
中信建投证券 股份有限公司	2	181,403,778.98	12.46%	126,984.78	12.46%	-
申银万国证券 股份有限公司	2	178,287,801.66	12.25%	124,803.18	12.25%	-
广发证券股份 有限公司	1	109,446,562.64	7.52%	76,612.58	7.52%	-
北京高华证券 有限责任公司	1	3,097,195.45	0.21%	2,168.04	0.21%	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

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。

注 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，能及时提供准确地信息资讯服务。

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。

注 3：报告期内，本基金退租以下交易单元：信达证券股份有限公司上海交易单元 1 个、国都证券有限责任公司上海交易单元 1 个、华西证券有限责任公司上海交易单元 1 个。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

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	
中信建投证券股份有限公司	2	1,412,328,354.67	66.03%	988,637.33	66.03%	-
申银万国证券股份有限公司	2	314,593,265.43	14.71%	220,215.30	14.71%	-
招商证券股份有限公司	1	178,413,859.45	8.34%	124,891.39	8.34%	-
中信证券股份有限公司	1	148,747,846.09	6.95%	104,123.50	6.95%	-
北京高华证券有限责任公司	1	84,853,685.30	3.97%	59,397.57	3.97%	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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。

注 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，能及时提供准确地信息资讯服务。

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。

注 3：报告期内，本基金退租以下交易单元：信达证券股份有限公司上海交易单元 1 个、国都证券有限责任公司上海交易单元 1 个、华西证券有限责任公司上海交易单元 1 个。

10.8 其他重大事件（转型后）

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增加北京农商行等为嘉实泰和混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 14 日
2	嘉实泰和混合型证券投资基金（原基金泰和）基金份额“确权”登记指引	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 15 日
3	嘉实基金管理有限公司关于增加中信银行等为嘉实泰和混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 21 日
4	嘉实基金管理有限公司关于增加东北证券等为嘉实泰和混合型证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 4 月 28 日
5	关于嘉实泰和混合型证券投资基金（基金代码：000595）增加部分证券公司为确权业务受理机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 5 月 5 日
6	嘉实泰和混合型证券投资基金集中申购结果暨原泰和证券投资基金基金份额折算结果的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 5 月 5 日
7	关于嘉实泰和混合型证券投资基金（基金代码：000595）增加华福证券等公司	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 5 月 9 日

	为代销机构和确权业务受理机构的公告		
8	关于嘉实泰和混合型证券投资基金（基金代码：000595）增加民族证券为代销机构和确权业务受理机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 5 月 19 日
9	关于嘉实泰和混合型证券投资基金（基金代码：000595）增加国海证券为代销机构和确权业务受理机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 5 月 28 日
10	关于增加邮储银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参与邮储银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2014 年 6 月 30 日

10.8 其他重大事件（转型前）

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召开泰和证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、管理人网站	2014 年 1 月 21 日
2	嘉实基金管理有限公司关于泰和证券投资基金停牌提示性公告	中国证券报、管理人网站	2014 年 1 月 24 日
3	关于召开泰和证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、管理人网站	2014 年 2 月 11 日
4	关于召开泰和证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、管理人网站	2014 年 2 月 18 日
5	嘉实基金管理有限公司关于召开泰和证券投资基金基金份额持有人大会的第三次提示性公告	中国证券报、管理人网站	2014 年 2 月 25 日
6	关于泰和证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告	中国证券报、管理人网站	2014 年 2 月 28 日
7	泰和证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告	中国证券报、管理人网站	2014 年 3 月 18 日
8	泰和证券投资基金 2013 年年度收益分	中国证券报、管理人网站	2014 年 3 月 19 日

	配公告		
9	泰和证券投资基金终止上市公告	中国证券报、管理人网站	2014 年 4 月 1 日
10	泰和证券投资基金终止上市的提示性公告	中国证券报、管理人网站	2014 年 4 月 3 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准泰和证券投资基金募集的文件；
- (2) 中国证监会核准泰和证券投资基金转型的文件；
- (3) 《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》；
- (4) 《嘉实泰和混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 《嘉实泰和混合型证券投资基金基金托管协议》；
- (6) 《泰和证券投资基金基金合同》；
- (7) 《泰和证券投资基金基金托管协议》；
- (8) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (9) 报告期内泰和证券投资基金、嘉实泰和混合型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

- (1) 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) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

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
2014 年 8 月 25 日