

泰和证券投资基金

[2011] 第二季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2011年7月20日

§ 1 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、完整性承担个别及连带责任。

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2011年7月18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。

本报告期未出现影响基金资产净值的不利因素。

本报告期自2011年4月1日起至2011年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 嘉实泰和封闭(上交所上市简称“基金泰和”)

基金主代码 500002

基金运作方式 约定型封闭式

基金合同生效日 1999/4/4/00:00

报告期末基金份额总额 2,000,000.0000份

投资目标 为投资组合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的投资方法。在综合宏观经济情况、政策取向、证券市场的多种因素的基础上，确定基金在股票、国债上的投资比例。坚持以基本面分析为基础，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。

业绩比较基准 无

风险收益特征 无

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期(2011年4月1日-2011年6月30日) 单位:人民币

1.本期已实现收益 -27,095.8765元

4,130,133.22元

3.加权平均基金份额本期利润 0.0021

4.期末基金资产净值 2,082,984,375.25元

5.期末基金份额净值 1.0415元

注:本基金本期实现收益指基金本期收入，投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用之和。本期利润指本期收入加上本期公允价值变动收益。①上述基金业绩指标

不包括持有人认购或申购基金的各项费用，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 本期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 纯值增长率 业绩比较基准收益 纯值比较基准收益

净差(%) 净差(%) 纯差(%) 纯差(%)

过去三个月 0.20% 2.29% ①-③ ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率历史走势图

图:嘉实泰和封闭累计份额净值增长率的历史走势图

(1999/4/4日至2011年6月30日)

注: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%;③:本基金由基金管理人

人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;④:遵守中国证监会规定的其

他比例限制。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

任竞辉 本基金基金经理 2010年10月10日 - 5年 曾任申万巴黎基金管理有限公司行业研究员,中国金融租赁有限公司行业研究员。2008年2月加盟嘉实基金管理有限公司任高级分析师。MBA,具有基金从业资格,中国国籍。

从4月开始公司期间,定期对基金经理作出决定后公告之日;②:本基金的含义从义泰从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作诚信守信情况的说明

报告期内,本基金运作严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《基金与证券投资基金合同》和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,严格控制风险的原则,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

和基金合同的约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的说明

4.3.1 平等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《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和公

司内部公平交易制度,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基金和组合。

4.3.2 本基金组合与其他投资风格相似的组合之间的业绩比较

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金的资产配置策略和业绩的说明

4.4.1 报告期内本基金的资产配置策略

4.4.2 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.3 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.4 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.5 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.6 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.7 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.8 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.9 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.10 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.11 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.12 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.13 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.14 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.15 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.16 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.17 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.18 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.19 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.20 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.21 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.22 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.23 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.24 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.25 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.26 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.27 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.28 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.29 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.30 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.31 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.32 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.33 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.34 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.35 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.36 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.37 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.38 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.39 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.40 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.41 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.42 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.43 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.44 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.45 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.46 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.47 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.48 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.49 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.50 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.51 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.52 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.53 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.54 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.55 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.56 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.57 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.58 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.59 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.60 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.61 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.62 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.63 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.64 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.65 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.66 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.67 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.68 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.69 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.70 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.71 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.72 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.73 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.74 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.75 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.76 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.77 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.78 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.79 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.80 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.81 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.82 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.83 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.84 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.85 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.86 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.87 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.88 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.89 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.90 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.91 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.92 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.93 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.94 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.95 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.96 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.97 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.98 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.99 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.100 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.101 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.102 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.103 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.104 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.105 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.106 报告期内本基金的资产配置情况

4.4.107 报告期内本基金的资产配置情况

4.