

信息披露 Disclosure

泰和证券投资基金

[2014] 第一季度报告

基金管理人:泰和基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2014年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期的财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	泰和证券投资基金
基金主代码	560002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	1999年4月8日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本报告期的财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年3月31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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期实现收益	65,281,482.27
2.本期利润	-98,359,627.44
3.报告期平均基金份额本期利润	-0.0492
4.期末基金份额净值	2,085,636.96/1.26
5.期末基金总资产	1,0428

(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)上述本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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告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 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

① ② ③ ④

过去三个月 -4.23% 2.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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图

注：嘉实泰和封闭累计份额净值增长率的历史走势图

3.2.3 本报告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 净值增长率为(%) 业绩比较基准收益率(%) 标准差(%)

① ② ③ ④

过去三个月 -4.23% 2.09%

3.3 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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期实现收益	65,281,482.27
2.本期利润	-98,359,627.44
3.报告期平均基金份额本期利润	-0.0492
4.期末基金份额净值	2,085,636.96/1.26
5.期末基金总资产	1,0428

(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)上述本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将低于所列数字。

3.4 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
张锐	本基金基金经理 研究部研究员 投资部基金经理	2013年6月19日	-	11年

注：(1)任本基金基金经理的日期为公司作出决定后公告之日；(2)证券从业的含义遵从行业协会的有关规定。

4.2 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平均交易制度的执行情况

报告期内，本基金严格按照证监会《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.3.2 交易时机选择的公平性

报告期内，本基金严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.3.3 报告期内遵守法律法规、行业监管规定和自律规则、社会公德的情况

报告期内，本基金严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.4 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.5 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.6 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.7 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.8 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.9 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.10 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.11 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.12 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.13 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.14 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.15 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.16 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.17 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.18 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.19 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.20 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.21 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.22 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.23 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.24 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。

4.25 管理人对本基金定期报告批准报出的说明

报告期内，本基金的管理人严格按照《证券投资基金》及其各项配套法规、《泰和证券投资基金合同》及基金招募说明书的有关约定，履行了报告、信息披露、投资决策和运行基金资产，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。