

泰和证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告送出日期:2013年10月24日

1.1 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、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人报告指出，报告内容内不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺就基金投资运作的合规性及运作基金资产，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。投资人风险，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。
本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至2013年9月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	泰和证券投资基金(上交所上市简称:基金泰和)
基金主代码	500002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	1999年4月6日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
投资目标	为投资者分享分散投资风险，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	本基金在综合宏观经济情况、政策取向、证券市场走势等多种因素的基础上，确定基金股票、债券上的投资比例。坚持以基本分析为主，综合运用技术分析、量化分析等方法，最终确定所投资的股票，并以技术分析辅助对投资时机的选择。
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

5.3 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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	247,624,532.71
2.本期利润	411,278,081.2
3.加权平均基金份额本期利润	0.2058
4.期末基金份额净值	2,707,480,185.32
5.期末基金份额净值	1.3537

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，本期利润在本期已实现收益的基础上加上公允价值变动收益。
(2)上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，计算费用后的实际收益请以基金净值为准。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	92,833,750.00	3.43
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,204,612,920.71	44.49
D	电力、热力、煤气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	405,418,851.72	14.97
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	279,487,130.45	10.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	58,827,072.00	2.17
M	科学研究、技术服务和地质勘查业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	64,230,093.20	2.37
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	29,856,818.88	1.10
S	综合	-	-
合计		2,135,266,636.96	78.87

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

单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	5,066,119	226,354,196.92	8.36
2	000333	美的集团	4,701,817	203,367,568.07	7.51
3	600151	上海家化	4,468,262	193,967,253.42	7.16
4	000895	双汇发展	3,218,388	149,494,122.60	5.52
5	600079	人福医药	4,711,057	135,309,089.08	5.00
6	300017	网宿科技	2,214,467	126,224,619.00	4.66
7	000998	隆平高科	4,036,250	92,833,750.00	3.43
8	601933	永辉超市	6,525,218	91,873,661.44	3.39
9	601607	上海医药	5,883,990	91,613,662.02	3.38
10	600827	友邦股份	8,199,370	88,061,233.80	3.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	59,944,000.00	2.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	487,895,000.00	18.02
4	企业债券	487,895,000.00	18.02
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,495,100.35	0.06
8	其他	-	-
合计		549,334,100.35	20.29

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

单位:人民币元

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(%)
1	130201	13国债01	2,200,000	219,450,000.00	8.11
2	130218	13国债18	2,000,000	198,660,000.00	7.34
3	120019	12国债国19	500,000	49,885,000.00	1.85
4	130236	13国债36	300,000	29,961,000.00	1.11
5	120245	12国开45	200,000	19,972,000.00	0.74

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	伊利股份	5,066,119	226,354,196.92	8.36	
2	美的集团	4,701,817	203,367,568.07	7.51	
3	上海家化	4,468,262	193,967,253.42	7.16	
4	双汇发展	3,218,388	149,494,122.60	5.52	
5	人福医药	4,711,057	135,309,089.08	5.00	
6	网宿科技	2,214,467	126,224,619.00	4.66	
7	隆平高科	4,036,250	92,833,750.00	3.43	
8	永辉超市	6,525,218	91,873,661.44	3.39	
9	上海医药	5,883,990	91,613,662.02	3.38	
10	友邦股份	8,199,370	88,061,233.80	3.25	

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	030201	13权证01	2,200,000	219,450,000.00	8.36
2	130218	13权证18	2,000,000	198,660,000.00	7.34
3	120019	12权证国19	500,000	49,885,000.00	1.85
4	130236	13权证36	300,000	29,961,000.00	1.11
5	120245	12权证45	200,000	19,972,000.00	0.74

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	伊利股份	5,066,119	226,354,196.92	8.36	
2	美的集团	4,701,817	203,367,568.07	7.51	
3	上海家化	4,468,262	193,967,253.42	7.16	
4	双汇发展	3,218,388	149,494,122.60	5.52	
5	人福医药	4,711,057	135,309,089.08	5.00	
6	网宿科技	2,214,467	126,224,619.00	4.66	
7	隆平高科	4,036,250	92,833,750.00	3.43	
8	永辉超市	6,525,218	91,873,661.44	3.39	
9	上海医药	5,883,990	91,613,662.02	3.38	
10	友邦股份	8,199,370	88,061,233.80	3.25	

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

单位:人民币元

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(%)
1	130201	13国债01	2,200,000	219,450,000.00	8.36
2	130218	13国债18	2,000,000	198,660,000.00	7.34
3	120019	12国债国19	500,000	49,885,000.00	1.85
4	130236	13国债36	300,000	29,961,000.00	1.11
5	120245	12国开45	200,000	19,972,000.00	0.74

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行人未涉及公共关系负面情况。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，本报告编制日前一年内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。

5.12 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位:人民币元

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(%)
1	110007	博时转债	934,201.40	0.03	

5.13 期末持有的处于受限状态的股权资产

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	798,134.50
2	应收证券清算款	-
3	应收红利	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
合计		11,529,272.95

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位:人民币元

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(%)