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

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 半年度 报告摘要

2014年6月30日

§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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

§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、固债上的投资比例。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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	(010)67595096
传真		(010)65182266	(010)66275853

2.4 信息披露方式

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

§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 报告期(2014年1月1日-2014年4月3日(基金合同终止日))	转型后 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:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=70%×(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+30%×(上证国债指数(t)/上证国债指数(t-1)-1)

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,…。

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

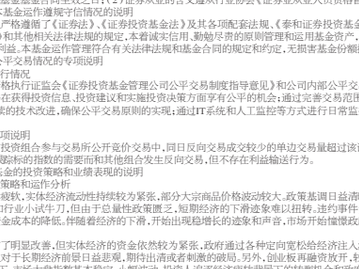

图:嘉实泰和混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014年4月4日至2014年6月30日)

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日至报告期末未满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、嘉实资金(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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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遵规守信情况的说明

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而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,连约事件开始出现,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,开始出现趋增长的迹象和声音,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,投资者对于长期经济前景日益悲观,期待出清或者刺激的就局。另外,创业板再融资放开,较低的发行价极引发了大量的资金参与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,以迂消费为主题配置,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、年中和年末估值复核与基金计账日的核对同时进行。

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历,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	782,363,868.12
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分配利润产生的基金净值变动	-	-497,200,000.85	-497,200,000.85
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 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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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

6.4.4 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。

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

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)	上年度可比期间 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	-	-

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。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)。

6.4.4.2.2 基金托管费

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)	上年度可比期间 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)。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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 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
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	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
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。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 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。

6.4.5.3.2 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 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