80.50

嘉实多元收益债券型证券投资基金 2009 年半年度报告摘要

2009年6月30日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事会、董事保证本报告所裁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。公司董事 Edouard Fernen Peter 先生未出席本次董事会。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 8 月 27 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所诺以诚实信用、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。基金的过程边锁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。本基金分为嘉实多元债券 A B,嘉实多元债券 A 收取认 申 购费和赎回费,但计提销售服多费。

學董亚乃列新天学及1917年 1917年 19

| 2 基金简介 | | |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 1 基金基本情况 | | |
| 基金名称 | 嘉实多元收益债券型证券投 | と资基金 |
| 基金简称 | 嘉实多元债券 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2008年9月10日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,372,845,117.68 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 嘉实多元债券 A | 嘉实多元债券 B |
| 下属两级基金的交易代码 | 070015 | 070016 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 537,489,845.18 份 | 835,355,272.50 分 |
| | 0.0010 | 0.0010 |

| 2 | 2 基金产品说明 | |
|---|----------|---|
| | 投资目标 | 本基金在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过谋求较高的当期收益,力争资产的长期稳定增值。 |
| | 投资策略 | 本基金投资策略由目上而下的资产尼盟计划和自下而上的单个证券选择计划组成。根据对宏观经济趋势,国家宏观政策趋势,行业及企业盈利和信用状况、债券 市场和股票市场信值水平及预期收益等动态分析、决定债券类、权益类资产配置 比例。债券类投资采取积极主动的投资策略包括确定债券组合久期,债券组合期 规结构及类属配置、单个资产选择、权益类投资作为辅助和补充,其最重要因素是 本金安全。 |
| | 业绩比较基准 | 中央国债登记结算公司的中国债券总指数 |
| | 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高 于货币市场基金。 |

| | | 限结构及类属配置、单个资产选择,权 本金安全。 | 益类投资作为辅助和补充,其最重要因素 |
|-----|-----------|-------------------------------|--------------------|
| | 业绩比较基准 | 中央国债登记结算公司的中国债券总 | 旨数 |
| | 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其长期平均风险 于货币市场基金。 | 和预期收益率低于股票基金、混合基金, |
| 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 |
| | 夕砂 | 袁尔其条等拥有限八司 | 由国工商组行职仍有限公司 |

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 | |
|------------|------|----------------------------------|-------------------------------------|--|
| 名称 | | 嘉实基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 姓名 | | 胡勇钦 | 蒋松云 | |
| 信息披露 | 联系电话 | 010)65215588 | 010) 66105799 | |
| ДДЛ | | service@jsfund.cn | custody@icbc.com.cn | |
| 客户服务电 | .话 | 400-600-8800 | 95588 | |
| 传真 注册地址 | | 010)65182266 | 010) 66105798 北京市西城区复兴门内大街 55 号 | |
| | | 上海市浦东新区富城路 99 号 震旦国际大楼 1702 室 | | |
| 办公地址 | | 北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 | |
| 邮政编码 | | 100005 | 100140 | |
| 法定代表人 | | 王忠民 | 姜建清 | |

| | 登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址 | http://www.jsfund.en |
|---|--------------------------|-------------------------------------|
| | 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

| | | 金额甲位:人民巾兀 | |
|------------------------|-----------------------------|----------------------|--|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 本报告期 2009 年 1 月 1 日 | 至 2009 年 6 月 30 日) | |
| 3.1.1 妈用可要对指个时间作示 | 嘉实多元债券 A | 嘉实多元债券 B | |
| 本期已实现收益 | 29,200,083.85 | 47,239,946.39 | |
| 本期利润 | 24,636,588.82 | 43,016,254.5 | |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0389 | 0.038 | |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.74% | 3.719 | |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.99% | 4.799 | |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 本报告期 2009 年 1 月 1 日 | F1月1日至2009年6月30日) | |
| 3.1.2 州木奴站中山自称 | 嘉实多元债券 A | 嘉实多元债券 B | |
| 期末可供分配利润 | 27,127,819.50 | 40,899,103.7 | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0505 | 0.049 | |
| 期末基金资产净值 | 575,757,319.00 | 893,564,523.7 | |
| 期末基金份额净值 | 1.071 | 1.07 | |
| 2 1 2 HILL HILL + 1645 | 本报告期 (2009年1月1日至2009年6月30日) | | |
| 3.1.3 累计期末指标 | 嘉实多元债券 A | 嘉实多元债券 B | |
| 基金份额累计净值增长率 | 10.34% | 10.029 | |
| 6) 朱加口守和收益"指其会本1 | 旧利自市 人 投资的 经 甘油水 | (不今八分价值亦到br 25 bn 18 | |

用后的余额、非期间的多中间上实现收益加上本期分允恰值变现收益。2 的评选基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实和收益加上本期分允恰值变现收益。2 的评选基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平型低于所列数字。6) 期末可供分配形间"采用期末资产负债券中未分配利润与未分配利润中已实现部分的缴帐款。6) 廣实多元债券 A 收取认 申 购费和赎回费,嘉实多元债券 B 不收取认 申 购费和赎回费,嘉实多元债券 B 不收取认 申 购费和赎回费。自计推销售服务费。

3.2 基金净值表现 3.2 基金份緬净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| | | | | | 그 나마셨다보는 하다 나니? | | | | |
|----|--------------|----|--------------|----|-----------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 3. | 2.1.1 嘉实多元 | 债券 | A 基金(| 分智 | 6净值增长率及 | 其与同期业组 | 乱比较基准收益率的 | 比较 | |
| | 阶段 | | 份额净(增长率) | | 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 |
| | 过去一个儿 | F | 2.10 | 0% | 0.22% | -0.31% | 0.03% | 2.41% | 0.19% |
| | 过去三个月 | 月 | 4.0 | 8% | 0.30% | 0.30% | 0.04% | 3.78% | 0.26% |
| | 过去六个人 | 月 | 4.9 | 9% | 0.27% | -1.24% | 0.14% | 6.23% | 0.13% |
| | 自基金合同生 至今 | 效起 | 10.3 | 4% | 0.24% | 8.69% | 0.24% | 1.65% | 0.00% |
| 3. | 2.1.2 嘉实多元 | 债券 | B基金的 | 分額 | 净值增长率及 | 其与同期业组 | 比较基准收益率的 | 比较 | |
| | 阶段 | | 腕净值 长率① | 份 | 獅净值增长率 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 |
| | | | | | | | | | |

| | 至今 | | | | | | | |
|-----|----------------|--------------|-----------------|----------------|-------------------|--------|-------|---|
| 3.2 | 2.1.2 嘉实多元 | 债券 B 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 | 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 | 2.10% | 0.22% | -0.31% | 0.03% | 2.41% | 0.19% | |
| | 过去三个月 | 4.08% | 0.30% | 0.30% | 0.04% | 3.78% | 0.26% | |
| | 过去六个月 | 4.79% | 0.27% | -1.24% | 0.14% | 6.03% | 0.13% | |
| | 自基金合同 生效起至今 | 10.02% | 0.25% | 8.69% | 0.24% | 1.33% | 0.01% | |
| 3.2 | 2.2 自基金合 | 司生效以来非 | 金份额累计净值均 | 曾长率变动及 | 其与同期业绩比较基 | 5准收益率 | 变动的比较 | Ŕ |

图 1:嘉实多元债券 A 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 2008年9月10日至2009年6月30日)

图 2: 嘉实多元债券 B 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 2008 年 9 月 10 日至 2009 年 6 月 30 日) 注 1: 本基金基金合同生效日 2008 年 9 月 10 日至报告期末未满 1 年。校基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日 2008 年 9 月 10 日至报告期末未满 1 年。校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,建仓期结束时本基金的投资组合比例符合基金合同 第十一部分基金的投资工,投资范围五 仁 股资组合限制"的约定。 注 2: 2009 年 2 月 13 日,本基金管理人发布 於于增聘嘉实多元基金基金经理的公告》,增聘王茜女士任本基金基金经理,与原基金经理刘廉先生共同管理本基金。

§ 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

4.1.2 基金经理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基 | 基金经理期限 | 证券从业 | 说明 |
|-----|--|------------|--------|------|--|
| XEA | 10 (3) F | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | 10097 |
| 刘熹 | 本基金基金 经理、嘉实债 券基金经理、 公司固定收 益部总监 | 2008年9月10日 | - | 15 | 曾任平安证券福田营业部分析师、中国平安保险投资管理中心投资经理。 巨田证券公司投资部副发型,招商证 券公司债券研究员。2003年2月加盟 嘉实基金、曾任嘉实策略混合基金经 理。经济学硕士,具有基金从业资格、中国国籍。 |
| 王茜 | | 2009年2月13日 | - | 7 | 曾任武汉市商业银行信贷资金管理部 总经理助理,中信证券固定收益部、长 废金债指数增强债券基金经理、长盛 货币基金经理。2008 年 11 月加盟嘉 实基金工而管理硕士,具有基金从业 资格,中国国籍。 |

4.3.3 异常交易行为的专项说明

44 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 截至报告期末嘉实多元债券 A 基金份额争值为 1.071 元, 本报告期基金份额争值增长率为 4.99%; 截至报告 期末嘉实多元债券 B 基金份额争值为 1.070 元, 本报告期基金份额争值增长率为 4.79%; 同期业绩比较基准收益

报告期内、经济星 V 型反转走势,投资拉动成为经济最大的充点。信贷超预期大规模投放成为支持投资放量和流动性高涨的主要因素。一季度内经济继续下滑,企业利润的在恶化,虽然有微弱的回升迹象但难以确认。一季度则表现为明显的经济反转。虽然外需仍持续被踢,但投资的拉动作用已经充分显现。由于流动性充裕达到前所未有的程度。国际大宗商品价格从底部快速上涨、虽然 CPI 同比仍处于通谐之中,但市场的通胀预期不断加强,通胀预测成分情市走势的主导力量。在水储市大方向非不乐观的背景下,上半年的贫城发性地採入和PO重启的发了循环两次大约下跌。对经济向好的预测以及充裕的流动性使得投资者风险偏好提升,股市转暖并累积了可观的涨幅,债市上交易性资金离场,股债转换完成。基于以上对宏观经济形势的判断,上半年本基金在资产配置上减持了固定收益率资产并大幅降低人期,同时适时增加了投票资产的配置比例,此外还适当参与了流动性较好的可转债和交易所信用债投资,为持有人创造了较为理处的投资阻极。 报告期内,经济呈 V 型反转走势,投资拉动成为经济最大的亮点,信贷超预期大规模投放成为支持投资放

时点过去,但总量仍处于极充裕的水平。二季度内巨量信贷下投资放量是经济呈 v 型反转的主要推动因素,而 新开工投资以及地方政府投资高增意味着下半年投资仍将维持高位。房地产和汽车的迅速回暖有望推动私人商

12世球。 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》、征券投资基金会计核算业务指引发及中国证监会标 关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行,基金份额争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会计账目的核对同时

。 本基金管理人设立估值专业委员会,委员由研究、固定收益、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人组成

本基金管理人设立估值专业委员会、委员由研究、固定收益、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人组成、负责研究、指导期内、研究、固定收益部门负责人同时兼任基金会性业人估值委员、参加估值专业委员会会议、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,中国证券经记结享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和间分配情况的说明
根据本基金基金合同第十五部分三、基金收益分配原则 1.在符合有关基金分红条件的前提下、本基金每年收益分配次数最多为12次、每年分配比例不得低于可供分配收益的 50%"5.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值"的约定。2009 年 2 月 26 日、本基金管理人以截至 2008 年 12 月 31 日的可供分配收益 5.884.736.88 元。2009 年 4 月 8 日、本基金管理人以截至 2008 年 12 月 31 日的可供分配收益 7.884.736.88 元。2009 年 4 月 8 日、本基金管理人以截至 2009 年 3 期 3 日的可供分配收益 7.884.736.88 元。2009 年 4 月 8 日、本基金管理人以截至 2009 年 3 月 31 日的可供分配收益 5.884.736.88 元。2009 年 4 月 8 日、本基金管理人以截至 2009 年 3 月 31 日的可供分配收益 5.884.736.88 元。2009 年 5 是新分配收益 5.884.736.88 元。2009 年 4 月 8 日、本基金管理人以截至 2009 年 3 月 31 日的可供分配收益为基准进行收益分配,嘉实多元债券 A 实施分配收益 5.832.38.79 元。嘉实多元债券 B 实施分配收益 10.669.554.41 元。

\$ 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 2009年上半年、本基金托管人在对嘉实多元收益债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资 基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规宁信。净值计算、利润分配等情况的识明 2009 年上半年、嘉文旁心底值游李迎诉教校基金的管理人一寨实基金管理有限公司在嘉实多元收益 债券型证券投资基金的投资运作、基金资产单值计算、基金份额申募帐回价格计算、基金贵用开支等问题上、不 存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,嘉 实多元收益储务型证券投资基金对基金份额持有人进行了两次利润分配、分配金额为 28.357.466.86 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 本托管人校注对最实基金管理有限公司编制和玻璃的嘉实多元收益债券型证券投资基金 2009 年半年度报 告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确 和定整

单位:人民币元

和完整。 § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

| 开土体: | :夯权页基亚 | |
|------|--------|-----------------------|
| 资产 | 附注号 | 本期末 2009年 6 月 30 日 |
| 资产 | | |

| | | | I limit had did to h |
|-----------------|----------|-----------------------|-------------------------|
| 资产 | 附注号 | 本期末 2009年 6 月 30 日 | 上年度末 2008年 12 月 31 日 |
| 资产 | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 37,211,957.75 | 90,246,287.98 |
| 结算备付金 | | 2,281,284.26 | 170,685.03 |
| 存出保证金 | | 1,114,615.95 | 125,000.00 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,457,373,974.80 | 2,682,050,845.63 |
| 其中:股票投资 | | 274,518,870.59 | 41,655,845.63 |
| 基金投资 | | _ | _ |
| 债券投资 | | 1,182,855,104.21 | 2,640,395,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | _ | _ |
| 买人返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | _ |
| 应收证券清算款 | | 7,195,634.06 | 7,778,474.34 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 30,057,257.76 | 22,659,959.49 |
| 应收股利 | | - | _ |
| 应收申购款 | | 9,961,120.52 | 61,201,665.26 |
| 递延所得税资产 | | - | _ |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | _ | _ |
| 资产总计 | | 1,545,195,845.10 | 2,864,232,917.73 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2009年 6 月 30 日 | 上年度末 2008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 | | 50,064,854.97 | 100,006,229.99 |
| 应付证券清算款 | | - | _ |
| 应付赎回款 | | 22,892,964.84 | 22,719,693.14 |
| 应付管理人报酬 | | 812,700.88 | 1,517,988.14 |
| 应付托管费 | | 232,200.29 | 433,710.90 |
| 应付销售服务费 | | 198,178.30 | 394,284.48 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,440,992.23 | 221,718.01 |
| 应交税费 | | 24,000.00 | |
| 应付利息 | | 1,646.16 | 2,793.91 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | _ |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 206,464.69 | 80,838.75 |
| 负债合计 | | 75,874,002.36 | 125,377,257.32 |
| 所有者权益 | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,372,845,117.68 | 2,640,816,511.87 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 96,476,725.06 | 98,039,148.54 |
| 所有者权益合计 | | 1,469,321,842.74 | 2,738,855,660.41 |
| DI H H IAMLE VI | | | |

注:报告截止日 2009 年 6 月 30 日,嘉实多元债券 A 基金份额净值 $\overline{1.071}$ 元,基金份额总额 537,489,845.18 嘉实多元债券 B 基金份额净值 $\overline{1.070}$ 元,基金份额总额 355,355,272.50 份;本基金基金份额总额 $\overline{1.372}$. 845,117.68 份。 6.2 利润表

主体:嘉实多元收益债券型证券投资基金

| 项目 | 附注号 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 |
|---------------|----------|----------------------------|
| 一、收人 | | 81,266,473.46 |
| 1.利息收入 | | 26,647,981.65 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 346,423.03 |
| 债券利息收入 | | 26,301,558.62 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买人返售金融资产收人 | | - |
| 其他利息收入 | | |
| 2.投资收益 | | 63,267,890.32 |
| 其中:股票投资收益 | 6.4.7.12 | 66,741,997.92 |
| 基金投资收益 | | _ |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -4,926,945.33 |
| 资产支持证券投资收益 | | _ |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - |
| 投利收益 | 6.4.7.15 | 1,452,837.73 |
| 3.公允价值变动收益 | 6.4.7.16 | -8,787,186.89 |
| 4.汇兑收益 | | |
| 5.其他收入 | 6.4.7.17 | 137,788.38 |
| 二、费用 | | -13,613,630.11 |
| 1.管理人报酬 | | -6,424,085.06 |
| 2.托管费 | | -1,835,452.89 |
| 3.销售服务费 | | -1,749,940.83 |
| 4.交易费用 | 6.4.7.18 | -3,114,756.78 |
| 5.利息支出 | | -238,804.06 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | -238,804.06 |
| 6.其他费用 | 6.4.7.19 | -250,590.49 |
| 三、利润总额 | | 67,652,843.35 |
| 所得税费用 | | _ |
| 四、净利润 | | 67,652,843.35 |

会计主体:嘉实多元收益债券型证券投资基金 本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 期初所有者权益 (基金净值) 2,640,816,511.87 98,039,148.54 2,738,855,660.41 本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) 67,652,843.35 本期基金份额交易产生的基金净值变 1,942,908,353.17 80,566,603.76 2,023,474,956.93 -3,210,879,747.36 -121,424,403.73 -3,332,304,151.09 、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) 1,372,845,117.68 96,476,725.06 1,469,321,842.74

;本基金合同生效日为2008年9月10日

0.4 证表的任 6.41 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。 6.42 差错更正的说明 报告期内,本基金不存在会计差错事项。

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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| | 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| | 国都证券有限责任公司 | 与基金管理人同受重大影响的公司、基金代销机构 |
| | | |

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。 6.4.1. 迪过关联方交易单元进行的交易 本期本基金未通过关联方交易单元进行交易。

2)基金托管费

| 6.4.4.2 大联力报酬 (1) 基金管理费 | | |
|----------------------------|-----------------------------------|-----|
| A V CENTRAL PARTY | 单位:人民币元 | |
| 项目 | 本期 2009年1月1日至 2009年6月30日 | |
| 当期应支付的管理费 | 6,424,085.06 | |
| 其中: 当期已支付 | 5,611,384.18 | |
| 期末未支付 | 812,700.88 | |
| | 里有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计 | 是,逐 |
| 3. 累计交运日日底 按日支付 甘计管 | 八十十二日管理人招酬_前一口其全咨产净值、0.700// 4年王粉 | |

| / 墨亚门目以 | 单位:人民币元 | |
|-----------|----------------------------------|----|
| 项目 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 | |
| 当期应支付的托管费 | 1,835,452.89 | |
| 其中: 当期已支付 | 1,603,252.60 | |
| 期末未支付 | 232,200.29 | |
| | 了的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提,逐日累计 | 至每 |

6)嘉实多元债券 B 销售服务费

| | | | 中世:八 |
|--------------|------------|--------------|------------|
| | | 本期 | |
| 获得销售服务费的 | 2009 | 年1月1日至2009年6 | 月 30 日 |
| 各关联方名称 | | 当期应支付的销售服务 | 费 |
| | 当期已支付 | 期末未支付 | 合计 |
| 嘉实基金管理有限公司 | 319,116.45 | 67,609.97 | 386,726.42 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 521,883.70 | 69,158.36 | 591,042.06 |
| 国都证券有限责任公司 | 2,123.77 | 219.97 | 2,343.74 |
| 合计 | 843,123.92 | 136,988.30 | 980,112.22 |

计提,逐日累计至每月月底,按月支付给嘉实基金管理有限公司,再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基 金销售机构。其计算公式为:日 B 类基金份额销售服务费=前一日 B 类基金份额资产净值x0.30%当年天数。 Φ) 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购)交易

| | | | | | | 単位:人: | 大口 |
|--------------|------|----------------------|----------|------|----------------|-----------|----|
| | 2009 | 本期 9年1月1日至 2009 年 | 6月30 | В | | | |
| 银行间市场交易的 | 债 | 券交易金额 | 基金进 | 色回购 | 基金正回 | 顺 | |
| 各关联方名称 | 基金买人 | 基金卖出 | 交易 金额 | 利息收入 | 交易 金額 | 利息 支出 | |
| 中国工商银行股份有限公司 | - | 460,468,777.75 | - | - | 474,012,000.00 | 13,892.70 | |

同。
6.4.4 各关联方投资本基金的情况
9. 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本期基金管理人未运用固有资金投资本基金。
0. 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 2009 年 6 月 30 日),上年度末 2008 年 12 月 31 日),其他关联方未投资本基金。

| .4.4.3 EXXXXXX E FYXX 11+3XXX | 贝久 二州 工口リイリモ | NAX/C |
|-------------------------------|---------------|----------------------------------|
| | | 单位:人民币元 |
| 关联方 名称 | 2009 | 本期 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日 |
| 45/5 | 期末余額 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 37,211,957.75 | 316,775.42 |
| 主:本基金的银行存款由基金托管人 | | 按银行同业利率计息。 |

6446 木基全在承销期内参与关联方承销证券的情况

2) 受限证券关别: 债券 期末 2009 年 6 月 30 日)本基金未持有流通受限的债券。 (g) 受限证券类别:其他 期末 (2009年6月30日)本基金未持有流通受限的其他证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌投票 期末 2009 年 6 月 30 日)本基金末持有暂时停牌的股票。 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 (1)银行间市场债券正回购 做至本报告期末2009年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 50.064.854.97元,是以如下债券作为质押:

| | | | | | | 金额单位:人 | 民币 |
|---|---------|------------|------------|------------|---------|---------------|----|
| | 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值 单价 | 数量 (张) | 期末估值总额 | |
| | | 08央行票据 104 | 2009-07-01 | 96.65 | 527,000 | 50,934,550.00 | |
| | 合计 | - | - | - | 527,000 | 50,934,550.00 | |
| 6 |) 交易所市场 | 债券正同睑 | | | | | |

②)交易所市场债券止凹购 期末本基金的交易所债券正回购余额为零。 § 7 投资组合报告

| 序号 | 项目 | 金額 | 占基金总资产的比例 %) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| | 权益投资 | 274,518,870.59 | 17.77 |
| 1 | 其中:股票 | 274,518,870.59 | 17.77 |
| | 固定收益投资 | 1,182,855,104.21 | 76.55 |
| 2 | 其中:债券 | 1,182,855,104.21 | 76.55 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| , | 买人返售金融资产 | - | - |
| 4 | 其中:买断式回购的买人返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 39,493,242.01 | 2.56 |
| 6 | 其他资产 | 48,328,628.29 | 3.13 |
| | 合计 | 1,545,195,845.10 | 100.00 |

| | | | 金额单位:人 |
|-----|----------------|----------------|--------------|
| 代码 | 行业 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 %) |
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| В | 采掘业 | 28,881,942.75 | 1.97 |
| C | 制造业 | 66,299,657.22 | 4.51 |
| CO | 食品、饮料 | - | - |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 7,497,539.40 | 0.51 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 13,319,632.54 | 0.91 |
| C5 | 电子 | - | _ |
| C6 | 金属、非金属 | 17,030,884.00 | 1.16 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 16,805,601.28 | 1.14 |
| C8 | 医药、生物制品 | 11,646,000.00 | 0.79 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 10,044,000.00 | 0.68 |
| E | 建筑业 | 17,571,682.24 | 1.20 |
| F | 交通运输、仓储业 | 3,177,000.00 | 0.22 |
| G | 信息技术业 | 8,430,000.00 | 0.57 |
| Н | 批发和零售贸易 | - | _ |
| I | 金融、保险业 | 68,621,684.26 | 4.67 |
| J | 房地产业 | 53,852,904.12 | 3.67 |
| K | 社会服务业 | - | _ |
| L | 传播与文化产业 | - | _ |
| M | 综合类 | 17,640,000.00 | 1.20 |
| | 合计 | 274,518,870.59 | 18.68 |

| 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 数量 (股) | 股票简称 | 股票代码 | 序号 |
|---------------|---------------|-----------|-------|--------|----|
| 1.30 | 19,125,000.00 | 1,500,000 | 万 科 A | 000002 | 1 |
| 1.22 | 17,928,000.00 | 800,000 | 招商银行 | 600036 | 2 |
| 1.14 | 16,805,601.28 | 1,009,952 | 柳工 | 000528 | 3 |
| 0.98 | 14,419,684.26 | 388,566 | 兴业银行 | 601166 | 4 |
| 0.97 | 14,256,000.00 | 1,800,000 | 民生银行 | 600016 | 5 |
| 0.95 | 13,945,000.00 | 500,000 | 保利地产 | 600048 | 6 |
| 0.91 | 13,361,882.24 | 1,098,839 | 葛洲坝 | 600068 | 7 |
| 0.89 | 13,023,942.75 | 1,100,925 | 海油工程 | 600583 | 8 |
| 0.89 | 13,008,000.00 | 800,000 | 北京银行 | 601169 | 9 |
| 0.79 | 11,646,000.00 | 360,000 | 双鹭药业 | 002038 | 10 |

en)的半年度报告正文。

7.4.1 累计买入金额前 20 名股票

| | | | | 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 | 000629 | 攀钢钢钒 | 77,853,220.00 | 2.5 |
| 2 | 000060 | 中金岭南 | 33,804,304.15 | 1. |
| 3 | 600048 | 保利地产 | 27,624,645.00 | 1. |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 24,931,760.45 | 0. |
| 5 | 000528 | 柳工 | 23,149,838.14 | 0. |
| 6 | 600005 | 武钢股份 | 21,037,974.13 | 0. |
| 7 | 601169 | 北京银行 | 20,635,415.00 | 0. |
| 8 | 600219 | 南山铝业 | 19,962,246.79 | 0. |
| 9 | 000829 | 天音控股 | 19,390,787.19 | 0. |
| 10 | 600016 | 民生银行 | 18,508,920.80 | 0 |
| 11 | 002106 | 莱宝高科 | 18,360,039.95 | 0 |
| 12 | 601166 | 兴业银行 | 17,781,026.22 | 0 |
| 13 | 601006 | 大秦铁路 | 17,490,000.00 | 0 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 17,276,666.00 | 0 |
| 15 | 000709 | 唐钢股份 | 16,754,561.50 | 0 |
| 16 | 000002 | 万 科 A | 16,627,885.97 | 0 |
| 17 | 000671 | 阳光城 | 16,578,933.20 | 0 |
| 18 | 000895 | 双汇发展 | 16,498,623.20 | 0. |
| 19 | 600068 | 葛洲坝 | 14,560,414.84 | 0. |
| 20 | 002038 | 双鹭药业 | 14,248,944.00 | 0. |

| 占期初基金资产净值比例 %) | 本期累计卖出金额 | 股票名称 | 股票代码 | 序号 |
|----------------|---------------|------|--------|----|
| 2.5 | 80,633,000.00 | 攀钢钢钒 | 000629 | 1 |
| 1.0 | 28,463,304.40 | 中金岭南 | 000060 | 2 |
| 3.0 | 22,599,560.32 | 莱宝高科 | 002106 | 3 |
| 0.7 | 21,771,961.19 | 南山铝业 | 600219 | 4 |
| 0.7 | 21,127,979.94 | 武钢股份 | 600005 | 5 |
| 0.7 | 19,565,315.02 | 唐钢股份 | 000709 | 6 |
| 0.7 | 19,369,994.38 | 中国平安 | 601318 | 7 |
| 0.0 | 18,805,678.30 | 保利地产 | 600048 | 8 |
| 0.0 | 18,451,281.39 | 天音控股 | 000829 | 9 |
| 0.0 | 17,913,050.95 | 双汇发展 | 000895 | 10 |
| 0.0 | 15,221,510.79 | 宝胜股份 | 600973 | 11 |
| 0.5 | 14,472,000.00 | 大秦铁路 | 601006 | 12 |
| 0.5 | 14,297,404.95 | 中信证券 | 600030 | 13 |
| 0.5 | 14,184,119.64 | 中国石化 | 600028 | 14 |
| 0.4 | 13,520,280.00 | 中国远洋 | 601919 | 15 |
| 0.4 | 12,882,091.76 | 中国石油 | 601857 | 16 |
| 0.4 | 12,544,375.50 | 金融街 | 000402 | 17 |
| 0.4 | 12,395,987.00 | 金晶科技 | 600586 | 18 |
| 0.4 | 12,371,962.31 | 啤酒花 | 600090 | 19 |
| 0.4 | 12,250,426.74 | 国电电力 | 600795 | 20 |

| 区示的权人忘彻 | |
|------------------------------------|---|
| 单位:人民币: | 元 |
| 1,101,525,352.53 | |
| 960,779,545.83 | |
| 出金额"及7.4.3项 买人股票成本"、卖出股票收入"均按买人或卖出 | 戎 |
| 不考虑相关交易费用。 | |
| | 单位:人民币: 1,101,525,322,53 960,779,545,83 出金緬"及 7.4.3 项 医人股票成本"、突出股票收入"均按妥人或类出 |

7.5 期末按券种分类的债券投资组合 占基金资产净值比例 %) 550,585,000.0 37.47 中:政策性金融债 132,357,913. 212,489,000.0 14.46 109,360,604.2 7.44 1,182,855,104.21

直比例 %)
 0801092
 08央行票据92
 1,700,000
 163,948,000.

 0881161
 08长电 CP02
 1,000,000
 101,160,000.
 163,948,000.00 11.16 125709 唐钢转债 010110 21国债(0) 673,697 81,133,329.71 700,870

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

期末本基金未持有资产支持证券。 7.8 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期末本基金未持有权证。

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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的发行主体未受到公开谴责、处罚

7.9.2 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。

| 3 其他资产构成 | ** | 单位:人民币元 |
|----------|---------|--------------|
| 序号 | 项目 | 金额 |
| 1 | 存出保证金 | 1,114,615.9 |
| 2 | 应收证券清算款 | 7,195,634.0 |
| 3 | 应收股利 | _ |
| 4 | 应收利息 | 30,057,257.7 |
| 5 | 应收申购款 | 9,961,120.5 |
| 6 | 其他应收款 | |
| 7 | 待摊费用 | |
| 8 | 其他 | |

| 9.4 期末 | 持有的处于转 | 专股期的可转换 | 快债券明细 | |
|--------|--------|---------|---------------|---------------|
| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 66) |
| 1 | 125709 | 唐钢转债 | 81,133,329.71 | 5.52 |
| 2 | 110002 | 南山转债 | 24,574,176.80 | 1.67 |
| 3 | 110003 | 新知转债 | 3.653.097.70 | 0.25 |

期末本基金持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份 份额级别 持有份额 持有份额 嘉实多元债券 4,503 119,362.61 401,161,391.94 74.64% 136,328,453.24 25.36% 嘉实多元债券

131,134.31 768,624,295.21 55.99% 604,220,822.47 44.01% 注: (1) 屬实多元债券 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例,分别为机 构投资者持有嘉实多元债券 A 份獨占嘉实多元债券 A 最份獨占例 个人投资者持有嘉实多元债券 A 总份獨占屬 实多元债券 A 总份獨占屬 主实多元债券 A 总份獨占例 个人投资者持有嘉实多元债券 B 总份额比例、2)高实多元债券 B 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有品额占总份额比例,分别为机投资者持有高实多元债券 B 份额占嘉实多元债券 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实多元债券 元债券 B 份额占嘉实多元债券 B 总份额比例。 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

份额级别 嘉实多元债券 A 1,413,115.60 嘉实多元债券 B

注:基金管理公司所有从业人员持有嘉实多元债券 $\mathbf A$ 份额总数占总份额比例,持有嘉实多元债券 $\mathbf B$ 份额总数占总份额比例,分别为从业人员持有嘉实多元债券 $\mathbf A$ 份额总数占嘉实多元债券 $\mathbf A$ 俭约额比例,从业人员持有 嘉实多元债券 B 份额总数占嘉实多元债券 B 总份额比例。 § 9 开放式基金份额变动

| (VJ dydXX7J1) | カロンマランプロ A | がたシル B |
|--------------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日 2008 年 9 月 10 日 基金份额总额 | 998,363,495.91 | 3,581,412,351.15 |
| 报告期期初基金份额总额 | 981,071,157.31 | 1,659,745,354.56 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 350,076,464.31 | 1,592,831,888.86 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 793,657,776.44 | 2,417,221,970.92 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 537,489,845.18 | 835,355,272.50 |
| 上,报告期期间基金总由购份额含红利再投,转换人份 | 麵,基金总赎回份麵含每 | 身換出份麵。 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议 报告期内未召开基金份额持有人大会。 10.2 基金管理人、基金管理人人的工作人工。 10.2 基金管理人人的重大人事变对情况 10.2.1 基金管理人的重大人事变对情况 2009年2月13日、本基金管理人发布(长于增聘嘉实多元基金基金经理的公告》,增聘王唐女士任本基金基金经理,与原基金经理刘熹先生共同管理本基金。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的

和合别内元涉及平益並管理人、基並则 10.4 基金投资策略的改变 报告期内本基金投资策略未发生改变。

报告期內本施並改取賴格亦及正成金。 10.5 为基金进行审计的设计师事务所情况 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有限公司。 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

10.7.1 股票交易情况

| | | | | | 金額 | 単位:人 |
|--------------------|----------------|----------------|----------------------|------------|------------------------|----------|
| | | 股票交易 | | 应支付该多 | 學商的佣金 | |
| 券商名称 | 交易 单元 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 | 备注 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2 | 455,115,485.46 | 22.21% | 384,402.24 | 22.49% | 新増1 个 |
| 海通证券股份有限公司 | 2 | 379,140,493.21 | 18.50% | 308,054.46 | 18.02% | 新増1 个 |
| 北京高华证券有限责任公司 | 2 | 350,622,333.89 | 17.11% | 294,987.63 | 17.26% | 新増 |
| 国信证券股份有限公司 | 1 | 202,758,732.20 | 9.89% | 172,346.06 | 10.08% | 新増 |
| 申银万国证券股份有限公司 | 1 | 81,818,783.19 | 3.99% | 69,546.24 | 4.07% | 新増 |
| 招商证券股份有限公司 | 2 | 156,341,071.69 | 7.63% | 132,890.27 | 7.77% | 新増 |
| 中信建投证券有限责任公司 | 1 | 49,187,713.42 | 2.40% | 41,809.08 | 2.45% | 新増 |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | 282,243,830.88 | 13.77% | 229,325.63 | 13.42% | 新増 |
| 国金证券股份有限公司 | 1 | 66,186,544.83 | 3.23% | 53,777.43 | 3.15% | 新増 |
| 中国建银投资证券有限责任公 司 | 1 | 26,002,229.66 | 1.27% | 22,101.63 | 1.29% | 新増 |
| 联合证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新増 |
| 中国国际金融有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新増 |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新増 |
| 德邦证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新増 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新増 |
| 国都证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新増 |
| 广发证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新増 |
| 长城证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 新増 |
| 华泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新増 |
| | | | | | | |

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;

公有良好的内结制度,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;
 6)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 10.7.2 债券交易情况 全频单位, 人民币元

| | 债券交易 | | | |
|----------------|----------------|------------------|--|--|
| 券商名称 | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 | | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 360,848,411.76 | 61.71% | | |
| 海通证券股份有限公司 | 60,765,518.72 | 10.39% | | |
| 北京高华证券有限责任公司 | 40,413,812.83 | 6.91% | | |
| 国信证券股份有限公司 | 28,248,333.45 | 4.83% | | |
| 申银万国证券股份有限公司 | 14,024,757.60 | 2.40% | | |
| 招商证券股份有限公司 | 8,165,229.92 | 1.40% | | |
| 中信建投证券有限责任公司 | 6,735,206.40 | 1.15% | | |
| 中信证券股份有限公司 | 56,434,191.96 | 9.65% | | |
| 国金证券股份有限公司 | 5,954,281.41 | 1.02% | | |
| 中国建银投资证券有限责任公司 | 3,127,584.49 | 0.53% | | |

| 0.7.3 债券回购父易情况 | | 金额单位:人民间 |
|--------------------------------------|---------------|--------------|
| 券商名称 | 回购交易 | |
| 37101-C100 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 |
| 国信证券股份有限公司 | 25,000,000.00 | 38.46% |
| 招商证券股份有限公司 | 40,000,000.00 | 61.54% |
| - Louis and Ale Hill Editories - men | | |

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 E-

2009年8月29日