嘉实多元收益债券型证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010年12月31日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2011年3月28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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月22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。

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。

本基金分为A、B类,A类收取认(申)购费和赎回费;B类不收取认(申)购费和赎回费,但计提销售服务费。

本报告期自2010年1月1日起至2010年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	嘉实多元债券	
基金主代码	070015	
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	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,973,157,441.75 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B
下属分级基金的交易代码	070015	070016
报告期末下属分级基金的份额总额	1,054,307,740.28 份	918,849,701.47 份

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	本基金投资策略由自上而下的资产配置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估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、债券组合期限结构及类属配置、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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	赵会军
	联系电话	010 ¥65215588	010 ¥6105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		010 ¥65182266	010 ¥6105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:/www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年		2009年		2008年	
	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B
本期已实现收益	84,788,039.73	78,826,149.05	50,491,436.72	80,877,775.41	34,118,198.19	49,168,754.65
本期利润	102,735,105.09	94,469,795.47	54,337,076.91	67,532,542.03	51,710,511.17	70,666,328.84
加权平均基金份额本期利润	0.1076	0.0979	0.0886	0.0702	0.0511	0.0437
本期加权平均净值利润率	9.90%	9.05%	8.32%	6.62%	5.00%	4.28%
本期基金份额净值增长率	10.29%	9.93%	10.22%	9.82%	5.09%	4.99%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末		2009年末		2008年末	
	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B
期末可供分配利润	51,128,241.39	37,723,578.40	43,755,329.82	45,125,109.17	21,032,210.00	32,829,104.52
期末可供分配基金份额利润	0.0485	0.0411	0.0793	0.0760	0.0214	0.0198
期末基金资产净值	1,162,100,837.99	1,005,845,064.60	614,267,825.05	659,022,217.29	1,018,523,251.97	1,720,332,408.44
期末基金份额净值	1.102	1.095	1.114	1.111	1.038	1.037
3.1.3 累计期末指标	2010年末		2009年末		2008年末	
	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B	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	27.75%	26.75%	15.83%	15.30%	5.09%	4.99%

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嘉实多元债券A收取认(申)购费和赎回费,嘉实多元债券B不收取认(申)购费和赎回费但计提销售服务费。

3.2 基金净值表现

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

嘉实多元债券A

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
过去三个月	2.89%	0.44%	-2.25%	0.16%	5.14%	0.28%
过去六个月	6.66%	0.32%	-1.45%	0.12%	8.11%	0.20%
过去一年	10.29%	0.27%	1.92%	0.10%	8.37%	0.17%
目基金合同生效起至今	27.75%	0.33%	10.78%	0.16%	16.97%	0.17%

嘉实多元债券B

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
过去三个月	2.81%	0.45%	-2.25%	0.16%	5.06%	0.29%
过去六个月	6.50%	0.33%	-1.45%	0.12%	7.95%	0.21%
过去一年	9.93%	0.28%	1.92%	0.10%	8.01%	0.18%
目基金合同生效起至今	26.75%	0.33%	10.78%	0.16%	15.97%	0.17%

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

注:根据本基金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二、投资范围五 C 投资组合限制"的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金基金合同生效日为2008年9月10日,2008年度的相关数据根据当年实际存续期(2008年9月10日至2008年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

嘉实多元债券A

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	1.1900	66,560,989.59	37,797,883.23	104,358,872.82	
2009年	0.2800	10,109,205.45	5,398,088.43	15,507,293.88	
2008年	0.1300	9,418,839.61	2,947,038.28	12,365,877.89	
合计	1.6000	86,089,034.65	46,143,009.94	132,232,044.59	

嘉实多元债券B

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	1.1900	47,620,281.79	56,802,674.96	104,422,956.75	
2009年	0.2600	13,049,063.15	13,355,844.45	26,404,907.60	
2008年	0.1300	11,471,127.74	9,017,214.50	20,488,342.24	
合计	1.5800	72,140,472.68	79,175,733.91	151,316,206.59	

§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。公司注册地在上海,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。

截至2010年12月31日,基金管理人共管理2只封闭式基金,21只开放式基金,具体包括嘉实泰和封闭、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300指数(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。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列证券投资基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金基金、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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王茜	本基金基金经理、公司固定收益部副总监。	2009年2月13日	-	8年	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,长盛债券基金基金经理、长盛货币基金经理。2008年11月加盟嘉实基金。工商管理硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:①任职日期、离任日期是指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《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

在报告期内,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、嘉实多元收益债券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,本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,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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

报告期内,嘉实多元债券A基金份额净值增长率为10.29%,嘉实多元债券B基金份额净值增长率为9.93%;投资风格相似的嘉实稳固收益债券基金份额净值增长率为-1.20%,嘉实债券基金份额净值增长率为7.05%,某债券组合份额净值增长率为3.06%。

主要原因:

相对于嘉实多元债券,嘉实债券与某债券组合不能主动参与股票二级市场,且权益类资产投资比例受到限制,而报告期内股票二级市场的结构性收益明显优于一级市场,导致嘉实债券与某债券组合业绩增长慢于嘉实多元债券;嘉实稳固收益债券为新基金,处于建仓期,由于基金合同要求,其投资策略及权益类可投资比例在组合构建初期受债券市场涨跌影响较大,而报告期内债券市场出现了较大幅度调整,导致其净值增长出现负收益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

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

2010年,国内经济基本面与政策面的变化基本符合我们在年初的预期,即经济整体增速回归均衡,从全年情况来看,投资增速相对09年略有下降,消费增速则保持平稳,净出口增速上升,GDP增长达到10.3%,这意味着金融危机两年之后复苏已经确立,因此宏观调控政策也顺应变化转为中性,即从宽松的货币政策转为稳健甚至偏紧,从普遍积极的财政政策转为更有针对性调整经济结构的财政政策,具体表现为央行全年6次上调存款准备金率,2次提高存贷款利率,重启人民币升值,以及国务院出台多个产业振兴规划与推进节能减排工作。

在这种宏观经济与政策背景下,风险资产在2010年整体表现不佳,一方面由于市场预期经济快速增长与09年宽松货币将滞后影响推高通胀水平,另一方面则由于多次出台紧缩货币的措施后,紧积效应导致社会资金面出现阶段性紧张,进而导致股债两市以震荡走势为主要特点,全年债券总全价指数下跌0.87%,上证指数下跌14.31%,新股申购收益在上半年颇为可观但到下半年受到新股供给大增,股市整体不振的影响而大幅缩水,我们根据这种市场特点,采取了债券资产短久期重防御,股票资产较低平均仓位重结构个股的策略,主要通过高票息信用债、转债、新股与二级市场股票交易获取组合正收益,为投资人取得了较为理想的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉实多元债券A基金份额净值为1.102元,本报告期基金份额净值增长率为10.29%;截至报告期末嘉实多元债券B基金份额净值为1.095元,本报告期基金份额净值增长率为9.93%;同期业绩比较基准收益率为1.92%。

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2011年,我们认为宏观经济将保持在复苏通道内,全年GDP增速有望达到9.5%左右,与此同时经济结构调整将进入实质阶段,表现在三大方面:一是经济增长三架马车的贡献对比将发生变化,消费的贡献上升,而投资与贸易顺差的贡献下降,具体将表现为欠发达地区和中低收入居民因政策入增长提速而产生的消费边际增长,房地产投资的大幅下滑被基础设施建设投资与保障性住房投资增长部分弥补,以及出口增速将相对进口增速逐渐下降;二是经济增长对信贷增长的依赖度将开始下降,社会直接融资渠道将更为畅通,同时鼓励国企与民间资金向海外市场的有序投资;三是纳入国家振兴规划的重点与新兴产业将受益于鼓励政策的实施而进入快速发展通道,而传统"三高"产业与低附加值制造业将面对更大的淘汰压力。在2011年,欧美经济的复苏势头将好于2010年,这将有利于我国出口产业发展,但存在进一步推高国际大宗商品价格的风险,从而导致我国输入型通胀压力增大,由于我们预期央行将保持紧缩性的货币政策,包括数量型与价格型工具的配合使用,能够使内部自生的通胀压力得到有效控制,因此对于全年通胀水平的判断是将保持高位,但不会出现恶性通胀,政府通胀目标可控。

基于对经济基本面和政策面的判断,我们认为2011年投资者对经济发展的信心将增强,而对通货膨胀的担忧已基本达到最坏程度,实际通胀水平低于预期的可能性较大,因此对于风险资产整体表现给出积极的预期,但不容忽视的是货币政策紧缩调控给未结束,因此社会流动性的收紧变化将对短期市场走势产生较大的波动影响,这可能包括央行严格回收流动性导致的资金价格起伏、股债新增供给大幅增加以及外部流动性受欧美货币政策变化的影响,具体到债券资产,我们认为下半年机会将大于上半年,上半年以来较短久期策略,以应对高水平波动的CPI与从紧的货币政策,但须逐步向中期久期回归,下半年伺时转为长久期策略取决于国内外经济环境共同作用下通胀预期的变化,这一时点的把握是最大的不确定性所在,我们认为银行受到贷款增长严厉控制下,对于债券配置的需求是较强的,但同时也会看到大量新增债券供给的出现,这与国家扩大社会直接融资的方针一致,因此依靠银行需求推升债券价格在今年不易实现,精选持有期收益高的债券品种将是更为有效的获取收益策略,在权益类资产上,我们的观点比2010年积极,但认为大年市尚未来临,因此除了将相对去年提高仓年平均股票仓位与可转债仓位外,还将遵循我国经济运行出现三大结构性变化的特点,发掘结构性和主题性的投资机会,同时将密切关注流动性短期波动导致的市场冲击,把握好买入卖出的时机选择,努力提高波段操作收益。

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会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、运营、风险管理、法律精核等部门负责人以及基金经理组成,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

①根据本基金基金合同第十五部分三、基金收益分配原则"7、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,嘉实多元债券A期末可供分配利润见已分配收益合计为127,672,236.44元,嘉实多元债券B期末可供分配利润及已分配收益合计为118,628,869.96元,应分别分配利润63,836,118.22元、59,314,434.98元以上。

②报告期内,嘉实多元债券A实施分配收益104,358,872.82元(其中分配2009年度利润27,814,877.77元,分配2010年度利润76,543,995.05元),嘉实多元债券B实施分配收益104,422,956.75元(其中分配2009年度利润23,517,665.19元,分配2010年度利润80,905,291.56元)。

③本基金管理人以截至2010年12月31日的可供分配收益为基准进行收益分配,权益登记日、除息日为2011年1月21日,红利发放日为2011年1月24日,嘉实多元债券A实施分配收益13,899,761.31元,嘉实多元债券B实施分配收益8,446,845.94元。

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

2010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

2010年,嘉实多元收益债券型证券投资基金的管理人——嘉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、基金资产净值计算、基金份额申购赎回的格计算、基金费用开支等问题上,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,嘉实多元收益债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了四次利润分配,分配金额为208,781,829.57元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实多元收益债券型证券投资基金2010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、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实多元收益债券型证券投资基金2010年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师汪棣、陈宇圣字出具了"无保留意见的审计报告"(普华永道中天审字(2011)第20645号)。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:嘉实多元收益债券型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	18,308,013.34	66,765,786.86
结算备付金		21,900,107.01	15,337,716.64
存出保证金		967,956.95	668,741.13
交易性金融资产	7.4.7.2	2,179,057,854.18	1,290,841,658.27
其中:股票投资		432,364,428.61	253,819,277.57
基金投资		-	-
债券投资		1,746,693,425.57	1,037,022,380.70
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		23,883,781.08	-
应收利息	7.4.7.5	18,422,407.59	4,254,982.46
应收股利		-	-
应收申购款		3,610,671.87	2,792,016.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,266,150,792.02	1,380,660,901.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		70,000,000.00	40,000,000.00
应付证券清算款		-	52,351,983.03
应付赎回款		23,327,258.48	12,615,721.57
应付管理人报酬		1,322,347.42	818,561.51
应付托管费		377,813.53	233,874.74
应付销售服务费		271,550.43	193,478.93
应付交易费用	7.4.7.7	968,233.27	1,034,936.33
应交税费		1,828,996.32	24,000.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	108,689.98	98,303.38
负债合计		98,204,889.43	107,370,859.49
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,973,157,441.75	1,144,922,863.95
未分配利润	7.4.7.10	194,788,460.84	128,367,178.39
所有者权益合计		2,167,945,902.59	1,273,290,042.34
负债和所有者权益总计		2,266,150,792.02	1,380,660,901.83

注:报告截止日2010年12月31日,嘉实多元债券A基金份额净值1.102元,基金份额总额1,054,307,740.28份;嘉实多元债券B基金份额净值1.095元,基金份额总额918,849,701.47份。嘉实多元债券基金份额总额合计为1,973,157,441.75份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实多元收益债券型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		231,268,591.94	150,423,578.19
1.利息收入		50,219,587.16	43,307,605.57
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,258,957.98	1,073,931.30
债券利息收入		48,868,451.80	42,233,674.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		92,177.38	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		147,017,539.71	116,409,685.44
其中:股票投资收益	7.4.7.12	134,043,645.09	112,272,746.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	12,741,705.81	1,095,746.90
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	856,395.71
股利收益	7.4.7.16	232,188.81	2,184,796.10
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	33,590,711.78	-9,499,593.19
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	440,753.29	205,880.37
减:二、费用		34,063,691.38	28,553,959.25
1.管理人报酬		14,562,996.96	11,840,617.31
2.托管费		4,160,856.19	3,383,033.46
3.销售服务费		3,128,019.67	3,084,555.28
4.交易费用	7.4.7.19	5,935,351.54	6,601,255.47
5.利息支出		5,801,019.64	3,151,253.10
其中:卖出回购金融资产支出		5,801,019.64	3,151,253.10
6.其他费用	7.4.7.20	475,447.38	493,244.63
三、利润总额		197,204,900.56	121,869,618.94
减:所得税费用		-	-
四、净利润		197,204,900.56	121,869,618.94

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实多元收益债券型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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)	1,144,922,863.95	128,367,178.39	1,273,290,042.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	197,204,900.56	197,204,900.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	828,234,577.80	77,998,211.46	906,232,789.26
其中:1.基金申购款	4,275,126,464.72	363,620,444.79	4,638,746,909.51
2.基金赎回款	-3,446,891,886.92	-285,622,233.33	-3,732,514,120.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-208,781,829.57	-208,781,829.57
五、期末所有者权益(基金净值)	1,973,157,441.75	194,788,460.84	2,167,945,902.59
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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)	2,640,816,511.87	98,039,148.54	2,738,855,660.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	121,869,618.94	121,869,618.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,495,893,647.92	-49,629,387.61	-1,545,523,035.53
其中:1.基金申购款	3,885,053,189.87	255,006,423.62	4,140,059,613.49
2.基金赎回款	-5,380,946,837.79	-304,635,811.23	-5,685,582,649.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-41,912,201.48	-41,912,201.48
五、期末所有者权益(基金净值)	1,144,922,863.95	128,367,178.39	1,273,290,042.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

赵学军 李松林 王红

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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一致。

7.4.2 差错更正的说明

报告期内本基金无涉及重大会计差错事项。

7.4.3 关联方关系

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
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东
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

注: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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
国都证券有限责任公司	139,412,783.57	3.76	226,534,978.17	5.34

7.4.4.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
国都证券有限责任公司	52,514,869.03	2.81	25,122,766.53	1.05

7.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
国都证券有限责任公司	1,473,600,000.00	5.28	1,972,200,000.00	8.85

7.4.4.1.4 权证交易

本期及上年度可比期间,本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
国都证券有限责任公司	118,500.44	3.83	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
国都证券有限责任公司	192,554.62	5.43	192,554.62	18.90

注:①上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,562,996.96	11,840,617.31
其中:支付给销售机构的客户维护费	1,106,280.65	1,306,752.36

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0.70%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:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,160,856.19	3,383,033.46

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B	合计
嘉实基金管理有限公司	-	1,417,961.42	1,417,961.42
中国工商银行股份有限公司	-	565,877.64	565,877.64
国都证券有限责任公司	-	1,861.29	1,861.29
合计	-	1,985,700.35	1,985,700.35
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B	合计
嘉实基金管理有限公司	-	955,565.41	955,565.41
中国工商银行股份有限公司	-	905,035.09	905,035.09
国都证券有限责任公司	-	3,361.90	3,361.90
合计	-	1,863,962.40	1,863,962.40

注:①支付基金销售机构的销售服务费按嘉实多元债券B基金份额前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,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×0.30%/当年天数。②嘉实多元债券A不收取销售服务费。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(包括回购)交易

单位:人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日				
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购	基金正回购
	基金买入	基金卖出	交易金额 利息收入	交易金额 利息支出
中国工商银行股份有限公司	30,398,240.72	172,605,483.28	- -	- -
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日				
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购	基金正回购
	基金买入	基金卖出	交易金额 利息收入	交易金额 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

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的