嘉实多元收益债券型证券投资基金

2011 半年度报告摘要

2011年6月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2011年8月24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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月19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;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。

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。

本报告期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实多元收益债券型证券投资基金	
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	2,052,514,054.01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	1,256,970,978.03份	795,543,075.98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、单个债券选择,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)66105799
	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)66105799

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	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)	
	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B
本期已实现收益	34,371,443.15	19,372,306.06
本期利润	-22,247,223.09	-10,552,838.25
加权平均基金份额本期利润	-0.0154	-0.0124
本期加权平均净值利润率	-1.41%	-1.15%
本期基金份额净值增长率	-0.90%	-1.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)	
	嘉实多元债券A	嘉实多元债券B
期末可供分配利润	78,592,548.98	42,394,783.91
期末可供分配基金份额利润	0.0625	0.0533
期末基金资产净值	1,360,001,507.18	853,506,409.18
期末基金份额净值	1.082	1.073
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)	
	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	26.60%	25.37%

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
过去一个月	0.00%	0.18%	-0.42%	0.10%	0.42%	0.08%
过去三个月	-0.73%	0.17%	0.36%	0.07%	-1.09%	0.10%
过去六个月	-0.90%	0.28%	1.03%	0.08%	-1.93%	0.20%
过去一年	5.70%	0.30%	-0.44%	0.10%	6.14%	0.20%
自基金合同生效起至今	26.60%	0.32%	11.91%	0.15%	14.69%	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
过去一个月	0.00%	0.17%	-0.42%	0.10%	0.42%	0.07%
过去三个月	-0.83%	0.16%	0.36%	0.07%	-1.19%	0.09%
过去六个月	-1.09%	0.28%	1.03%	0.08%	-2.12%	0.20%
过去一年	5.34%	0.31%	-0.44%	0.10%	5.78%	0.21%
自基金合同生效起至今	25.37%	0.32%	11.91%	0.15%	13.46%	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

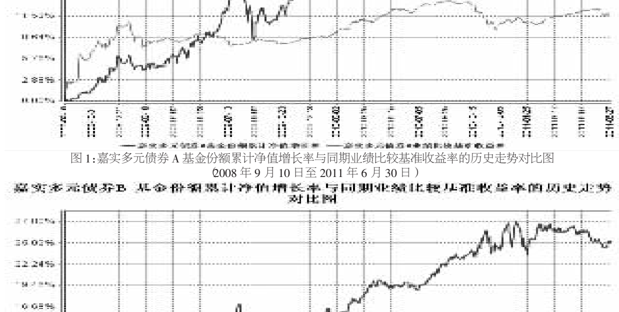

图1:嘉实多元债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年9月10日至2011年6月30日)

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2011年6月30日)

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(二)投资组合限制"的约定。

§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2011年6月30日,基金管理人共管理2只封闭式基金、23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、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票。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(助理)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、嘉实多利分级债券基金经理、公司固定收益部副总监。	2009年2月13日	-	8	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

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-0.90%、嘉实多元债券B基金份额净值增长率为-1.09 %;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0.10 %、嘉实债券基金份额净值增长率为-0.96%、嘉实多利分级债券基金份额净值增长率为-0.32%、某债券组合份额净值增长率为-0.41%。

主要原因:报告期内,相对于嘉实稳固收益的资产配置,嘉实债券和嘉实多元债券在权益类资产配置过重,因股票市场及转债市场的下跌给其净值增长带来了较大损失;嘉实多利是一只新建仓基金,严格高风险资产的仓位控制,因此相对受损较小。此外,由于转债相对于股票下跌幅度较小,因此某债券组合净值增长率的负增长情况相对较少。

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

报告期内,宏观经济调控政策把控制通胀放在首位,货币政策从紧的基调一直持续,数量型和价格型货币工具均发挥作用,即央行每月上调一次法定存款准备金率0.5个百分点,在2月和4月各提高法定基准利率0.25个百分点,广义货币供应量M2的增速在4-6月持续低于16%的全年目标增速。在政策调控的作用下,经济增速逐步放缓:采购经理人指数、工业增加值增速、社会零售和净出口等重要经济指标均表现出整体温和下滑的态势,但固定资产投资增速保持高位运行,体现出经济仍存在比较强劲的内在增长动力,硬着陆的可能性很小,这也为中央坚定调控通胀提供了信心。值得注意的是,上半年的国际负面经济事件频发,外围环境动荡不安。重大的事件包括:一,欧债危机卷土重来,引发欧美资本市场与国际大宗商品价格震荡;二是日本大地震破坏全球重要工业供应链,打击市场信心;三是美国第二次量化宽松政策到期与债务接近上限引发的不确定性,也对市场造成一定的信心冲击。

基于以上宏观经济基本面与政策环境,上半年的资本市场表现整体呈箱体震荡走势。债券市场在6月份之前受到经济增长数据下滑、下半年通胀水平将趋势性下降,以及日本地震、欧债问题等内外因素的支撑,呈小幅波动中缓步上涨的走势,但在6月由于法定存款准备金率多次上调的累积效应导致债市资金面非常紧张,同时通胀数据连续超出市场预期引发对下半年通胀回落程度的担忧,债市快速下跌,直到6月末才出现技术性小幅反弹。股票市场则是在4月份之前,以高铁和水利建设等投资主题板块的带领下波动上涨,市场对于经济增速和政策松紧程度预期乐观,而后出现逆向的纠正,伴随着外围经济负面事件的频频爆发,一路下跌到6月中旬,之后同样转入技术性反弹阶段。

根据对宏观经济基本面、资金面与市场的把握,本基金在债券资产上的策略是先短久期后中性久期,在一季度重点配置短期信用债券,然后在二季度逐步减持,转而配置中期信用产品与长期利率产品,提高静态票息收益的同时加长组合久期,为下半年债市投资环境改善后的行情做好准备。在权益类资产方面,则采取仓位灵活调整和适度集中配置的策略,但由于对二季度股票市流动性判断过于乐观,主观认为在房地产市场紧缩之后投资资金将流入股票市场,即使我们在5月份对权益类资产的配置思路进行了调整,但股票资产的下跌仍使基金净值遭受了较大的损失。

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1.082元,本报告期基金份额净值增长率为-0.90%;截至报告期末嘉实多元债券B基金份额净值为1.073元,本报告期基金份额净值增长率为-1.09%;同期业绩比较基准收益率为1.03%。

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年下半年,我们认为宏观经济增速将转为平稳,全年GDP增长有望达到9.5%的较好水平,一方面是以保障房和水利建设为代表的政府投资将在下半年集中释放,而通胀的下降有利于促进消费增长,另一方面是全年的新增信贷额度为7-7.5万亿,由于上半年严格控制在约3.48万亿的水平,意味着下半年的新增信贷要大幅高于往年同期水平,这对于推动经济增长是有利的。通胀将在下半年回落已成为市场共识,争议主要存在于回落的幅度,我们认为CPI有望在12月回落到4%以下,全年CPI约为4.9%,中央的通胀调控目标能够实现,因此货币政策继续加大紧缩力度的可能性小,而维持在现有力度的可能性大。资本市场的投资环境相比上半年将有一定程度的改善,投资机会大于上半年。基于以上判断,本基金将坚持"多元化的低风险盈利模式",本着稳健原则,对债券类资产久期中性策略,重点配置较高收益的投资级信用产品和中长期利率产品;对权益类资产采取谨慎乐观的观点,风险控制下精选个股,力争为投资人获取低风险的较好投资回报。

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、交易、基金运营、风险管理、法律稽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,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

根据本基金基金合同第十五部分三、收益分配原则"3.基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配",以及本报告3.1嘉实多元债券A"本期利润"为-22,247,223.09元,嘉实多元债券B"本期利润"为-10,552,838.25,因此报告期内嘉实多元债券A、嘉实多元债券B未实施当期利润分配。

附说明:本基金的基金管理人于2011年1月18日发布《嘉实多元收益债券证券投资基金2010年第四次收益分配公告》,实施本基金2010年第四次利润分配,嘉实多元债券A每10份基金份额发放红利0.10元;嘉实多元债券B每10份基金份额发放红利0.10元,具体参见本报告"6.4.11 利润分配情况"。

§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

2011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

2011年上半年,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、基金份额申购赎回价格计算、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一次利润分配,分配金额为22,346,607.25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2011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、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2011年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	52,513,822.48	18,308,013.34
结算备付金		16,656,945.76	21,900,107.01
存出保证金		804,932.78	967,956.95
交易性金融资产	6.4.7.2	2,306,645,515.23	2,179,057,854.18
其中:股票投资		354,756,892.43	432,364,428.61
基金投资		-	-
债券投资		1,951,888,622.80	1,746,693,425.57
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	491,396,297.09	-
应收证券清算款		7,868,874.59	23,883,781.08
应收利息	6.4.7.5	21,672,625.33	18,422,407.59
应收股利		630,000.00	-
应收申购款		1,699,792.43	3,610,671.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,899,888,805.69	2,266,150,792.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010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		642,000,000.00	70,000,000.00
应付证券清算款		33,062,088.37	-
应付赎回款		6,415,090.19	23,327,258.48
应付管理人报酬		1,350,878.92	1,322,347.42
应付托管费		385,965.41	377,813.53
应付销售服务费		217,015.81	271,550.43
应付交易费用	6.4.7.7	755,321.84	968,233.27
应交税费		1,993,096.76	1,828,996.32
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	201,432.03	108,689.98
负债合计		686,380,889.33	98,204,889.43
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,052,514,054.01	1,973,157,441.75
未分配利润	6.4.7.10	160,993,862.35	194,788,460.84
所有者权益合计		2,213,507,916.36	2,167,945,902.59
负债和所有者权益总计		2,899,888,805.69	2,266,150,792.02

注:报告截止日2011年6月30日,嘉实多元债券A基金份额净值1.082元,基金份额总额1,256,970,978.03份;嘉实多元债券B基金份额净值1.073元,基金份额总额795,543,075.98份;嘉实多元债券基金份额总额合计为2,052,514,054.01份。

6.2 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:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入		-12,470,589.28	62,987,029.58
1.利息收入		36,409,542.00	21,103,294.77
其中:存款利息收入	6.4.7.11	466,084.60	494,624.53
债券利息收入		34,486,591.47	20,578,044.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,456,865.93	30,625.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益		37,553,432.46	54,017,011.88
其中:股票投资收益	6.4.7.12	30,696,320.65	46,407,335.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,486,562.30	7,434,187.16
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,370,549.51	175,488.81
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-86,543,810.55	-12,210,495.35
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	110,246.81	77,218.28
减:二、费用		20,329,472.06	13,943,571.86
1.管理人报酬		8,662,664.80	6,218,860.98
2.托管费		2,475,047.06	1,776,817.37
3.销售服务费		1,371,682.22	1,401,385.74
4.交易费用	6.4.7.18	2,780,690.18	2,715,613.82
5.利息支出		4,802,398.09	1,607,028.55
其中:卖出回购金融资产支出		4,802,398.09	1,607,028.55
6.其他费用	6.4.7.19	236,989.71	223,865.40
三、利润总额		-32,800,061.34	49,043,457.72
减:所得税费用		-	-
四、净利润		-32,800,061.34	49,043,457.72

6.3 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:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	1,973,157,441.75	194,788,460.84	2,167,945,902.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-32,800,061.34	-32,800,061.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	79,356,612.26	21,352,070.10	100,708,682.36
其中:1.基金申购款	1,567,592,594.42	147,738,542.52	1,715,331,136.94
2.基金赎回款	-1,488,235,982.16	-126,386,472.42	-1,614,622,454.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-22,346,607.25	-22,346,607.25
五、期末所有者权益(基金净值)	2,052,514,054.01	160,993,862.35	2,213,507,916.36
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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)	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)	-	49,043,457.72	49,043,457.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	881,966,053.18	83,039,085.05	965,005,138.23
其中:1.基金申购款	1,483,133,287.94	135,483,240.70	1,618,616,528.64
2.基金赎回款	-601,167,234.76	-52,444,155.65	-653,611,390.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-107,424,384.40	-107,424,384.40
五、期末所有者权益(基金净值)	2,026,888,917.13	153,025,336.76	2,179,914,253.89

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

基金管理公司负责人　　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

报告期内,本基金不存在重大会计差错事项。

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(中国工商银行)	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

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	-	-	125,215,199.60	7.45%

注:本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	-	-	50,500,081.53	6.20%

注:本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	-	-	1,298,600,000.00	10.00%

注:本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.4.1.4 权证交易

本期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	106,432.40	7.57%	106,432.40	12.39%

注:(1)本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金无应支付关联方的佣金。(2)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、经手费后的净额列示。债券交易不计佣金。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。

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 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,662,664.80	6,218,860.98
其中:支付销售机构的客户维护费	731,319.53	482,209.65

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0.7%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× 0.7% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,475,047.06	1,776,817.37

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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× 0.2% / 当年天数。

6.4.4.2.3 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 2011年1月1日至2011年6月30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	-	408,207.10	408,207.10
中国工商银行	-	303,615.30	303,615.30
国都证券有限责任公司	-	465.47	465.47
合计	-	712,287.87	712,287.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	-	703,336.63	703,336.63
中国工商银行	-	265,079.11	265,079.11
国都证券有限责任公司	-	925.06	925.06
合计	-	969,340.80	969,340.80

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0.3%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×0.3%/当年天数。(2)嘉实多元债券A不收取销售服务费。

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

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日					
	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	20,687,851.51	275,007,608.79	-	-	422,400,000.00	138,316.12
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日					
	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	30,398,240.72	20,826,803.16	-	-	-	-

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

本期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本期末(2011年6月30日)及上年度末(2010年12月31日),其他关联方未持有本基金。

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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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
中国工商银行	52,513,822.48	297,919.09	18,477,494.07	382,373.15

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010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。

6.4.5 期末(2011年6月30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

6.4.5.1.1 受限证券类别:股票

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601113	华鼎锦纶	2011年4月28日	2011年8月12日	ipo网下锁定三个月	14.00	14.26	971,168	13,596,352.00	13,848,855.68	-

6.4.5.1.2 受限证券类别:债券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
122080	11康美债	2011年6月23日	2011年7月5日	未上市	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	网下申购

6.4.5.1.3 受限证券类别:其他

本期末(2011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
000876	新希望	2011年6月29日	筹划重大资产重组停牌	19.95	2011年7月5日	21.95	300,000	6,151,978.41	5,985,000.00	-

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(2011年6月30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

截至本报告期末2011年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额642,000,000.00元,于2011年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	354,756,892.43	12.23
	其中:股票	354,756,892.43	12.23
2	固定收益投资	1,951,888,622.80	67.31
	其中:债券	1,951,888,622.80	67.31
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	491,396,297.09	16.95
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	69,170,768.24	2.39
6	其他各项资产	32,676,225.13	1.13
7	合计	2,899,888,805.69	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	41,093,917.27	1.86
C	制造业	145,206,266.22	6.56
C0	食品、饮料	37,453,151.78	1.69
C1	纺织、服装、皮毛	13,848,855.68	0.63
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	9,074,395.00	0.41
C6	金属、非金属	32,014,480.83	1.45
C7	机械、设备、仪表	39,285,382.93	1.77
C8	医药、生物制品	13,530,000.00	0.61
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	56,885,000.00	2.57
F	交通运输、仓储业	28,080,000.00	1.27
G	信息技术业	21,243,220.00	0.96
H	批发和零售贸易	12,033,588.97	0.54
I	金融、保险业	36,174,899.97	1.63
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	14,040,000.00	0.63
M	综合类	-	-
	合计	354,756,892.43	16.03

7.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601668	中国建筑	9,000,000	36,270,000.00	1.64
2	600028	中国石化	3,000,000	24,690,000.00	1.12
3	300197	铁汉生态	310,000	20,615,000.00	0.93
4	000786	北新建材	1,200,000	19,092,000.00	0.86
5	600887	伊利股份	1,134,630	18,891,589.50	0.85
6	601699	潞安环能	499,967	16,403,917.27	0.74
7	601006	大秦铁路	2,000,000	16,380,000.00	0.74
8	600406	国电南瑞	429,400	15,587,220.00	0.70
9	600880	博瑞传播	1,000,000	14,040,000.00	0.63
10	601113	华鼎锦纶	971,168	13,848,855.68	0.63

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(http://www.jsfund.cn)的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额前20名的股票投资明细

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	000630	铜陵有色	45,191,305.05	2.08
2	600028	中国石化	43,773,407.32	2.02
3	601668	中国建筑	39,265,523.00	1.81
4	601288	农业银行	34,123,940.00	1.57
5	601699	潞安环能	29,573,559.69	1.36
6	600880	博瑞传播	22,587,657.04	1.04
7	600376	首开股份	22,268,720.77	1.03
8	000786	北新建材	21,539,338.82	0.99
9	300197	铁汉生态	20,949,800.00	0.97
10	600887	伊利股份	19,965,942.26	0.92
11	300186	大华农	19,360,000.00	0.89
12	601299	中国北车	18,530,000.00	0.85
13	600276	恒瑞医药	17,411,053.00	0.80
14	600085	同仁堂	17,111,761.96	0.79
15	601088	中国神华	16,717,310.09	0.77
16	600406	国电南瑞	15,564,199.62	0.72
17	600068	葛洲坝	15,248,313.38	0.70
18	600048	保利地产	14,952,022.10	0.69
19	002304	洋河股份	14,754,170.00	0.68
20	000063	中兴通讯	14,327,545.74	0.66

7.4.2 累计卖出金额前20名的股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000630	铜陵有色	46,414,643.59	2.14
2	601288	农业银行	32,131,220.00	1.48
3	000039	中集集团	28,428,961.12	1.31
4	601118	海南橡胶	26,043,964.21	1.20
5	300134	大富科技	23,112,000.61	1.07
6	600376	首开股份	23,017,438.47	1.06
7	300144	宋城股份	20,111,731.30	0.93
8	600085	同仁堂	19,536,698.24	0.90
9	600169	太原重工	17,829,244.30	0.82
10	601088	中国神华	17,368,212.08	0.80
11	600028	中国石化	17,072,707.85	0.79
12	002122	天马股份	16,643,393.10	0.77
13	002041	登海种业	16,324,004.53	0.75
14	600276	恒瑞医药	16,155,800.74	0.75
15	600139	西部资源	15,920,136.33	0.73
16	002304	洋河股份	15,605,714.45	0.72
17	601006	大秦铁路	15,288,901.78	0.71
18	600048	保利地产	15,008,560.85	0.69
19	600674	川投能源	14,414,385.90	0.66
20	000755	山西三维	14,028,245.52	0.65

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	899,533,077.25
卖出股票收入(成交)总额	945,424,605.28

注:7.4.1项"买入金额"、7.4.2项"卖出金额"及7.4.3项"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买入或卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	262,712,272.50	11.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	457,821,000.00	20.68
	其中:政策性金融债	457,821,000.00	20.68
4	企业债券	785,746,397.80	35.50
5	企业短期融资券	299,623,000.00	13.54
6	中期票据	-	-
7	可转债	145,985,952.50	6.60
8	其他	-	-
9	合计	1,951,888,622.80	88.18

7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122065	11上港01	1,800,000	178,902,000.00	8.08
2	019105	11国债05	1,500,000	150,243,650.00	6.79
3	110235	11国开35	1,300,000	128,739,000.00	5.82
4	110238	11国开38	1,000,000	100,010,000.00	4.52
5	110306	11进出06	800,000	79,008,000.00	3.57

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

报告期末,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

报告期末,本基金未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	804,932.78
2	应收证券清算款	7,868,874.59
3	应收股利	630,000.00
4	应收利息	21,672,625.33
5	应收申购款	1,699,792.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,676,225.13

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	63,348,000.00	2.86
2	110011	歌华转债	22,662,000.00	1.02

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601113	华鼎锦纶	13,848,855.68	0.63	ipo网下锁定三个月

§8 基金份额持有人信息

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	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
嘉实多元债券A	11,449	109,788.71	895,877,074.61	71.27%	361,093,903.42	28.73%
嘉实多元债券B	10,992	72,374.73	171,942,796.97	21.61%	623,600,279.01	78.39%
合计	20,317	101,024.46	1,067,819,871.58	52.02%	984,694,182.43	47.98%

注:(1)嘉实多元债券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份额占嘉实多元债券A总份额比例、个人投资者持有嘉实多元债券A份额占嘉实多元债券A总份额比例;(2)嘉实多元债券B:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例,分别为机构投资者持有嘉实多元债券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

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	嘉实多元债券A	255,622.58	0.02%
	嘉实多元债券B	319,128.50	0.04%
	合计	574,751.08	0.03%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实多元债券A	嘉实多元债券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
本报告期期初基金份额总额	1,054,307,740.28	918,849,701.47
本报告期基金总申购份额	984,226,238.41	583,366,356.01
减:本报告期基金总赎回份额	781,563,000.66	706,672,981.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,256,970,978.03	795,543,075.98

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1)基金管理人的重大人事变动情况

2011年5月起,王忠民先生因任期届满并退休,不再担任本基金管理人董事长职务,公司董事兼总经理赵学军先生代任董事长职务;2011年8月起安奎先生任本基金管理人董事长。

(2)基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内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、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司,报告期内未改聘。

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 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
国信证券股份有限公司	1	553,346,406.37	31.99%	470,343.91	32.51%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	261,955,251.76	15.14%	212,839.69	14.71%	-
国金证券股份有限公司	1	201,407,563.14	11.64%	163,644.45	11.31%	-
北京高华证券有限责任公司	2	191,362,169.39	11.06%	160,438.42	11.09%	-
中信建投证券有限责任公司	2	184,050,509.45	10.64%	156,442.63	10.81%	-
中信证券股份有限公司	2	104,779,600.13	6.06%	85,134.37	5.88%	-
招商证券股份有限公司	2	92,622,881.87	5.35%	78,729.13	5.44%	-
中国国际金融有限公司	1	77,920,645.39	4.50%	66,233.19	4.58%	-
兴业证券股份有限公司	1	62,358,150.78	3.60%	53,004.33	3.66%	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注:1:本表"佣金"指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

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;

(3)有良好的内控制度,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;

(5)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,并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券股份有限公司	269,606,670.59	36.79%	10,291,000,000.00	42.12%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	169,358,440.48	23.11%	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	102,047,978.58	13.92%	1,446,300,000.00	5.92%	-	-
中信建投证券有限责任公司	78,848,956.10	10.76%	1,668,000,000.00	6.83%	-	-
中信证券股份有限公司	26,502,603.20	3.62%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	22,384,096.88	3.05%	5,777,000,000.00	23.65%	-	-
中国国际金融有限公司	21,765,147.00	2.97%	1,278,900,000.00	5.23%	-	-
兴业证券股份有限公司	42,390,137.89	5.78%	3,970,000,000.00	16.25%	-	-

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-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2011年8月24日