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:2013年3月28日

嘉实多元收益债券型证券投资基金

2012年度报告摘要

2012年12月31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2013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2012年1月1日起至2012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	744,153,019.39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	367,899,548.35份	376,253,471.04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1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	2012年		2011年		2010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	5,623,432.73	6,666,587.57	14,503,271.49	3,629,076.06	84,788,039.73	78,826,149.05
本期利润	10,863,470.62	14,500,986.39	-30,647,890.00	-19,201,232.84	102,735,105.09	94,469,795.47
加权平均基金份额本期利润	0.0201	0.0310	-0.0262	-0.0256	0.1076	0.0979
本期加权平均净值利润率	1.88%	2.93%	-2.42%	-2.39%	9.90%	9.05%
本期基金份额净值增长率	2.41%	2.16%	-1.36%	-1.74%	10.29%	9.93%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末		2011年末		2010年末	
期末可供分配利润	673,227.90	-2,746,615.19	24,755,410.70	14,323,136.92	51,128,241.39	37,723,578.40
期末可供分配基金份额利润	0.0018	-0.0073	0.0373	0.0265	0.0485	0.0411
期末基金资产净值	389,626,322.05	394,893,170.12	714,729,846.58	575,397,249.64	1,162,100,837.99	1,005,845,064.60
期末基金份额净值	1.059	1.050	1.077	1.066	1.102	1.095
3.1.3 累计期末指标	2012年末		2011年末		2010年末	
基金份额累计净值增长率	29.05%	27.24%	26.01%	24.55%	27.75%	26.75%

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	-0.66%	0.23%	0.56%	0.03%	-1.22%	0.20%
过去六个月	-1.50%	0.25%	0.16%	0.05%	-1.66%	0.20%
过去一年	2.41%	0.24%	2.51%	0.07%	-0.10%	0.17%
过去三年	11.41%	0.26%	10.46%	0.09%	0.95%	0.17%
自基金合同生效起至今	29.05%	0.30%	20.05%	0.13%	9.00%	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	-0.66%	0.23%	0.56%	0.03%	-1.22%	0.20%
过去六个月	-1.60%	0.26%	0.16%	0.05%	-1.76%	0.21%
过去一年	2.16%	0.24%	2.51%	0.07%	-0.35%	0.17%
过去三年	10.36%	0.26%	10.46%	0.09%	-0.10%	0.17%
自基金合同生效起至今	27.24%	0.30%	20.05%	0.13%	7.19%	0.17%

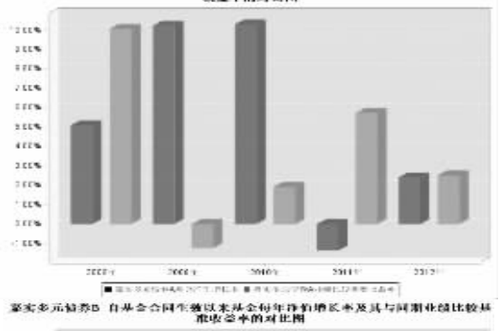
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

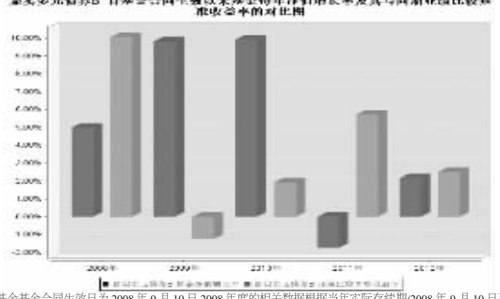
图1:嘉实多元债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2008年9月10日至2012年12月31日)

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2012年12月31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个月向为建仓期。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。

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
2012年	0.4370	16,705,179.40	8,111,218.17	24,816,397.57	2011年第一次利润分配于2012年实施
2011年	0.1000	9,931,659.75	3,968,101.56	13,899,761.31	2010年第四次利润分配于2011年实施
2010年	1.1900	66,560,989.59	37,797,883.23	104,358,872.82	
合计	1.7270	93,197,828.74	49,877,202.96	143,075,031.70	

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
2012年	0.3870	7,333,246.10	11,982,853.38	19,316,099.48	2011年第一次利润分配于2012年实施
2011年	0.1000	3,270,985.95	5,175,859.99	8,446,845.94	2010年第四次利润分配于2011年实施
2010年	1.1900	47,620,281.79	56,802,674.96	104,422,956.75	
合计	1.6770	58,224,513.84	73,961,388.33	132,185,902.17	

§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,总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。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2012年12月31日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金,37只开放式证券投资基金,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、嘉实黄金(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。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券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

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、嘉实多利分级债券基金经理、公司固定收益部总监。	2009年2月13日	-	10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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》,按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议,并在投资决策委员会的制度规范下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离,任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利,共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素,交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行证监会《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;对投资交易行为进行监察稽核,通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息,每季度和每年度完成公平交易专项稽核。

公司采用基金业通用的公平交易模块,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,统计数据显示,正、负溢价次数和等溢价次数符合随机分布的特征,平均溢价率趋近于0。

报告期内,公司旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

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

2012年中国经济成功实现了软着陆、工业增加值增速、国内生产总值增速等宏观经济指标从年初开始一路下行,在三季度才见底回升,CPI则在10月降至2010年以来的低点后微幅反弹。但此轮经济见底的时点显著晚于市场在年初时的普遍预期。主要原因在于:1)欧债危机的反复、美国经济弱复苏过程中的波折影响了中国的出口,全年出口增速低于年初10%的政府目标;2)国内房地产市场受调控政策影响,销售同比大幅下滑导致房地产投资增速也出现了08年金融危机后最迅猛的下降;3)央行出于对通胀的担心,在放松货币的政策选择上表现谨慎,仅在二季度下调一次存款准备金率、两次基准利率,同时政府类项目大规模融资的挤出效应使得实体经济的融资成本一直维持在高位;4)经历09年大规模刺激以来,社会的产能过剩、企业负债偏高的情况更为突出。多种因素叠加,在融资成本高企、需求疲弱、产能过剩的情况下,企业去库存的进程缓慢、加杠杆的热情骤减,导致经济的增速下降超过了市场乃至政府的预期。三季度后政府基建类投资开始大幅增加,美国经济的复苏趋势也基本确立,降准、降息的政策改应也逐步发挥作用,国内经济才呈现出触底企稳的迹象。

在这样的宏观经济和政策背景下,2012年股债市场走出了股熊债牛的走势。市场预期与实体经济状况、政策出台时机之间的偏差以及资金面因素是导致市场在此期间反复的主要因素。一季度基于对两会政策预期的背景下,股票市场有较大涨幅,利率债市场仅在1月延续了2011年四季度的牛市后就进入调整期,而中低评级信用债因乐观的经济预期收益率下降明显。二季度后随着政策预期落空和不断低于预期的经济数据的发布,股市一路走低,创出09年以来的新低,债市再掀一波牛市。三季度资金面的紧张导致股债齐跌。随着政府换届的顺利完成和经济数据的企稳回升,股票市场在12月大幅上扬;同时债券市场在央行大量逆回购支持下收益率仅小幅波动,静态收益更高的信用债更受市场追捧。转债市场走势与股市趋同,全年收益主要来源是债转股升。

本基金在过去一年的操作中在大类资产配置和类属资产配置上存在一定的失误,业绩并不理想。一季度尽管我们规避了利率债的风险,却因对长期信用风险的慎重而错失了本年度低等级信用债野蛮生长的行情;二季度由于我们对政策和经济相对乐观的预判,错过了债券市场一波小牛市的机会;下半年我们及时抓住了三季度债券市场调整的机会,增配优质的中低信用等级信用债,波段操作了利率品种,把握了四季度以来的债市行情。权益类资产方面,上半年精选个券的策略获得了较好的收益,但下半年市场风格变化后,我们没有及时调仓以及塑化剂事件对组合重仓股的冲击,给组合收益带来了较大负面影响。

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1.059元,本报告期基金份额净值增长率为2.41%;截至报告期末嘉实多元债券B基金份额净值为1.050元,本报告期基金份额净值增长率为2.16%;同期业绩比较基准收益率为2.51%。

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2013年,欧元区经济预计仍将在底部徘徊,美国在经历一季度财政悬崖冲击后经济将重回缓慢复苏的轨道。国内经济在新一轮库存周期驱动下有望延续小幅回暖的趋势,但考虑到生产与库存的结构性矛盾,以及经济增长的源头——信贷、货币供应量增速已开始放缓,未来经济增速继续上升的空间和时间均有限。中国中长期的经济增长仍需要等待进一步改革的推动。

基于以上判断,我们认为在经济处于寻找新一轮增长引擎的起点、市场估值已经充分反映悲观预期的情况下,大类资产配置的切换已经开始,但这一时段可能需要一段比较长的时间。我们预计全年权益类资产收益有望好于纯债资产,其中权益类资产受国内外经济、政策的影响在期间内可能出现较大幅度的波动,纯债资产中利率品种与信用品种之间的收益差异将较2012年显著收窄。组合资产配置上需要更加均衡。2013年一季度,在经济数据、财报真空期和两会前夕,股票市场积极乐观的情绪预计仍会延续。债市在资金面宽松、融资成本下降的政策背景下在一季度也将有收益率下行的动力,但经济的逐步复苏、CPI的上行压力将制约债市表现的空间。同时需要注意的是,资产质量问题的后周期特征、上层对影子银行的态度以及对政府融资平台的监管收紧等因素都可能影响到信用债市场。在具体的操作中,我们将平衡固定收益和权益资产的配置,适当提高权益类资产的比例中枢,积极把握阶段性机会;并优选个股;纯债资产方面,我们将控制好组合久期,类属资产上仍以信用产品为主,并适时把握利率产品的波段操作机会;对于信用债,我们将加大风险排查力度,警惕可能的信用风险,在关注信用长期风险的同时积极参与市场博弈机会。

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、运营、风险管理、法律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

(1)本基金的基金管理人于2012年1月12日发布《嘉实多元收益债券型证券投资基金2011年第一次收益分配公告》,实施本基金2011年第一次利润分配,嘉实多元债券A及嘉实多元债券B分别每10份基金份额发放红利0.187元,具体参见本报告"7.4.11 利润分配情况"。

(2)本基金的基金管理人于报告期内实施了2次利润分配,符合基金合同十五(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%"的约定。具体参见本报告"7.4.11 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

2012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

2012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、基金分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二次利润分配,分配金额为44,132,497.05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2012年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2012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,注册会计师许康玮、金毅签字出具了"无保留意见的审计报告"(普华永道中天审字(2013)第20086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:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	32,321,020.57	61,862,442.80
结算备付金		18,337,789.49	43,330,912.24
存出保证金		286,709.78	351,922.57
交易性金融资产	7.4.7.2	1,231,843,454.24	1,600,108,219.06
其中:股票投资		135,527,529.98	154,101,211.00
基金投资		-	-
债券投资		1,096,315,924.26	1,446,007,008.06
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		-	7,898,009.20
应收利息	7.4.7.5	15,292,516.68	26,532,580.31
应收股利		-	-
应收申购款		350,176.81	672,024.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,298,431,667.57	1,740,756,110.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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		496,159,130.32	438,449,683.32
应付证券清算款		10,149,428.23	5,026,430.52
应付赎回款		4,063,893.18	3,450,655.28
应付管理人报酬		502,760.51	794,124.66
应付托管费		143,645.87	226,892.76
应付销售服务费		101,927.06	151,175.36
应付交易费用	7.4.7.7	434,367.71	399,447.15
应交税费		1,993,226.58	1,993,152.76
应付利息		71,146.19	36,132.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	292,649.75	101,320.34
负债合计		513,912,175.40	450,629,014.68
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	744,153,019.39	1,203,867,881.90
未分配利润	7.4.7.10	40,366,472.78	86,259,214.32
所有者权益合计		784,519,492.17	1,290,127,096.22
负债和所有者权益合计		1,298,431,667.57	1,740,756,110.90

注:报告截止日2012年12月31日,嘉实多元债券A基金份额净值1.059元,基金份额总额367,899,548.35份;嘉实多元债券B基金份额净值1.050元,基金份额总额376,253,471.04份。嘉实多元债券基金份额总额合计为744,153,019.39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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		48,772,013.21	-10,065,388.54
1.利息收入		48,279,218.28	78,148,987.69
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,500,512.48	918,443.65
债券利息收入		43,311,927.51	67,250,365.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,466,778.29	9,980,178.05
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-12,735,502.68	-20,382,836.82
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-31,872,819.04	-14,173,870.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	16,417,517.38	-9,190,666.45
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,719,798.98	2,981,700.09
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	13,074,436.71	-67,981,470.39
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	153,860.90	149,930.98
减:二、费用		23,407,556.20	39,783,734.30
1.管理人报酬		7,535,326.37	14,517,533.88
2.托管费		2,152,950.32	4,147,866.80
3.销售服务费		1,484,469.90	2,420,756.22
4.交易费用	7.4.7.18	2,202,106.02	4,348,875.05
5.利息支出		9,566,117.04	13,874,822.59
其中:卖出回购金融资产支出		9,566,117.04	13,874,822.59
6.其他费用	7.4.7.19	466,586.55	473,879.76
三、利润总额		25,364,457.01	-49,849,122.84
减:所得税费用		-	-
四、净利润		25,364,457.01	-49,849,122.84

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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	1,203,867,881.90	86,259,214.32	1,290,127,096.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,364,457.01	25,364,457.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-459,714,862.51	-27,124,701.50	-486,839,564.01
其中:1.基金申购款	1,231,420,774.90	89,031,471.29	1,320,452,246.19
2.基金赎回款	-1,691,135,637.41	-116,156,172.79	-1,807,291,810.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-44,132,497.05	-44,132,497.05
五、期末所有者权益(基金净值)	744,153,019.39	40,366,472.78	784,519,492.17

项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	1,973,157,441.75	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)	-	-49,849,122.84	-49,849,122.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-769,289,559.85	-36,333,516.43	-805,623,076.28
其中:1.基金申购款	1,843,125,513.33	163,797,892.18	2,006,923,405.51
2.基金赎回款	-2,612,415,073.18	-200,131,408.61	-2,812,546,481.79
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)	1,203,867,881.90	86,259,214.32	1,290,127,096.22

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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(“中国工商银行”)	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

7.4.4 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。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2012年1月1日至2012年12月31日)及上年度可比期间(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,535,326.37	14,517,533.88
其中:支付销售机构的客户维护费	886,195.01	1,321,109.55

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,152,950.32	4,147,866.80

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。

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 2012年1月1日至2012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	-	420,913.03	420,913.03
中国工商银行	-	196,508.75	196,508.75
合计	-	617,421.78	617,421.78

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	-	751,087.86	751,087.86
中国工商银行	-	533,784.55	533,784.55
合计	-	1,284,872.41	1,284,872.41

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。

7.4.4.3 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 2012年1月1日至2012年12月31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	10,265,161.43	295,565,520.11	-	-	791,720,000.00	152,842.00

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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