嘉实多元收益债券型证券投资基金 2017年年度报告摘要

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:2018 年 03 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 2018 年 3 月 23 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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	382, 432, 152.36 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	313, 357, 769.49 份 69, 074, 382.87 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	胡秀钦	邹明
	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@sfund.cn	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		400- 600- 8800	95588
传真		(010)65215588	(010)66105798

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	2017年		2016年		2015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	14, 769, 919.71	3, 341, 456.15	- 36, 273.21	1, 408, 408.66	15, 202, 106.72	17, 062, 235.33
本期利润	14, 140, 782.14	3, 256, 818.65	- 3, 456, 763.01	- 3, 505, 349.75	17, 601, 129.86	19, 080, 937.26
加权平均基金份额本期利润	0.0438	0.0387	- 0.0229	- 0.0264	0.1151	0.1049
本期加权平均净值利润率	3.78%	3.37%	- 1.96%	- 2.27%	9.75%	8.94%
本期基金份额净值增长率	3.90%	3.54%	0.47%	0.16%	13.85%	13.40%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015年末	
期末可供分配利润	19, 953, 047.28	3, 782, 049.48	19, 807, 038.52	5, 614, 719.92	12, 813, 005.07	18, 139, 074.35
期末可供分配基金份额利润	0.0637	0.0548	0.0590	0.0535	0.0849	0.0787
期末基金资产净值	365, 997, 289.62	80, 004, 101.18	391, 061, 766.32	121, 522, 542.77	181, 552, 146.71	275, 586, 889.70
期末基金份额净值	1.168	1.158	1.165	1.159	1.203	1.196
3.1.3 累计期末指标	2017年末		2016年末		2015年末	
基金份额累计净值增长率	77.65%	72.21%	70.98%	66.32%	70.19%	66.06%

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	净值增长率①	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	0.74%	0.13%	- 0.87%	0.09%	1.61%	0.04%
过去六个月	2.13%	0.10%	- 0.55%	0.07%	2.68%	0.03%
过去一年	3.90%	0.08%	- 1.19%	0.09%	5.09%	- 0.01%
过去三年	18.84%	0.40%	8.12%	0.11%	10.72%	0.29%
过去五年	37.66%	0.35%	17.74%	0.12%	19.92%	0.23%
自基金合同生效起至今	77.65%	0.33%	41.35%	0.13%	36.30%	0.20%

嘉实多元债券 B

阶段	净值增长率①	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	0.61%	0.13%	- 0.87%	0.09%	1.48%	0.04%
过去六个月	1.97%	0.10%	- 0.55%	0.07%	2.52%	0.03%
过去一年	3.54%	0.08%	- 1.19%	0.09%	4.73%	- 0.01%
过去三年	17.60%	0.41%	8.12%	0.11%	9.48%	0.30%
过去五年	35.34%	0.35%	17.74%	0.12%	17.60%	0.23%
自基金合同生效起至今	72.21%	0.33%	41.35%	0.13%	30.86%	0.20%

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

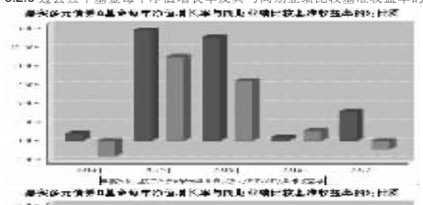
(2008 年 9 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日)

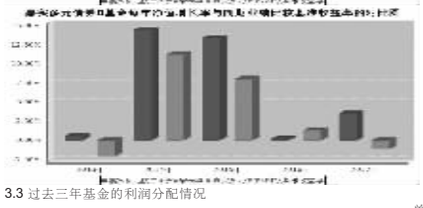
图 2:嘉实多元债券 B 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008 年 9 月 10 日至 2017 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。

3.2.3 过去五年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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位: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
2017年	0.4130	11, 501, 265.38	1, 846, 793.75	13, 348, 059.13	
2016年	0.4310	2, 698, 381.42	2, 610, 876.00	5, 309, 257.42	
2015年	1.0110	7, 043, 975.31	7, 610, 427.90	14, 654, 403.21	
合计	1.8550	21, 243, 622.11	12, 068, 097.65	33, 311, 719.76	

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
2017年	0.4090	1, 078, 118.85	2, 519, 583.91	3, 597, 702.76	-
2016年	0.3850	1, 592, 396.71	3, 151, 948.05	4, 744, 344.76	-
2015年	0.9160	5, 588, 651.42	7, 658, 923.43	13, 247, 574.85	-
合计	1.7100	8, 259, 166.98	13, 330, 455.39	21, 589, 622.37	

§ 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 2017 年 12 月 31 日,基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、141 只开放式证券投资基金,具体包括嘉实元和、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、嘉实优质企业混合、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、嘉实海外中国股票混合(QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数(LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、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、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、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、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票基金、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油(QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实稳愉债券、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实稳悦纯债债券、嘉实致博纯债债券、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合(FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票。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

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、嘉实多利分级债券、嘉实新机遇混合发起式、嘉实新起点混合、嘉实新起航混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实致博纯债债券基金经理,公司固定收益业务体系配置策略组组长	2009年 2 月 13 日	-	15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 月加盟嘉实基金管理有限公司,现任固定收益业务体系配置策略组组长。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,及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内,公司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,未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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 19 次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,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

就 2017 年 4 个季度的经济回顾来看,整体经济呈现弱稳定、小幅下行的格局,上半年经济增速 6.9%,下半年小幅回落至 6.8%。扣除价格因素之后,投资增速小幅回落,消费增速大体平稳。CPI 水平维持窄幅震荡,下半年中枢较上半年有所抬升。PPI 指数受到前期基数影响出现高位回落,但整体同比仍然维持较高增速。2017 年,从主要券种的季度收益率比较来看,债券市场整体出现收益率水平的明显抬升。最终 10 年国债收益率从 2016 年末的 3.3%左右上行至 3.9%左右,而信用债整体收益率上行幅度更大。从区间走势来看,债券市场波动有所加大。以十年国债为例,主要的上行时间集中在 2 季度和 4 季度,波动幅度均在 30-40BP。信用债整体利差由历史较低水平整体出现大幅度提升,目前多数品种已经回到历史均值水平附近。就股票市场而言,全年依然出现了明显的风格分化,沪深 300 为代表的大盘股持续震荡上行,全年收益率超过 20%。而创业板为代表的成长股整体仍然震荡下行,全年下跌幅度达到 10%。

2017 年,本基金全年保持了债券资产的低杠杆和低久期,其间适当参与了信用债和利率债的波段操作,收益相对较好。下半年,在控制风险的前提下,逐步提高股票资产的配置比重,获取了一定收益,但由于风格相对分散,在去年风格分化明显的市场环境中,收益不突出。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实多元债券 A 的基金份额净值为 1.168,本报告期基金份额净值增长率为 3.90%;截至本报告期末嘉实多元债券 B 的基金份额净值为 1.158,本报告期基金份额净值增长率为 3.54%;同期业绩基准收益率为 -1.19%。

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 2018 年经济,整体上我们判断:经济在今年上半年仍然维持弱稳定格局。一方面基建投资在上半年继续保持稳定,而制造业投资有望筑底,从而带动整体固定资产投资维持前期水平。进入下半年,前期对于金融领域的管控可能会对实体经济产生小幅的压力,经济增速可能出现小幅回落。就债券市场而方,我们认为长期国债收益率可能已经进入顶部区间,未来可能高位震荡,但可能 1-3 个月的中短期内难以看到明显回落。最主要的逻辑是,当前的收益率水平对经济的阶段性压力可能逐渐会有所体现,未来可能出现的基本面情况是,经济增速平稳,同时货币政策偏紧但逐渐稳定。因此可能长期国债收益率延续高位震荡。下半年,随着政策紧缩的边际影响减弱,同时经济可能出现小幅下降,债市整体收益率存在一定的下行空间。同时,从历史规律来看,未来信用利差持续提升的规律仍然没有出现变化,未来更需要警惕的是仍然是中低等级信用利差的持续提升。就股票市场而言,从全年维度来看,我们的整体判断:降低预期收益,需要强化止盈止损策略。整体的背景是,宏观基本面难以超预期,总量盈利增速较为稳定。龙头股票的估值提升空间较小。市场风格方面,我们认为可能会有所均衡,大盘股的相对优势将会削弱,而成长股的估值劣势也有所降低。

基于以上判断,2018 年本基金将基于中性策略择机逐步加大债券资产的配置比重及久期,重点关注利率债尤其是金融债的波段操作机会。同时,在权益市场,整体会保持中性偏谨慎的参与比例,以高分红、低估值配置标的为主,同时也加大关注风险释放之后,出现的优质小盘成长股的配置机会。

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、合规等部门负责人组成,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但不限于上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算公司,中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

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 2017 年 1 月 17 日发布《嘉实多元收益债券型证券投资基金 2016 年第三次收益分配公告》,收益分配基准日为 2016 年 12 月 31 日,本期 B 类份额每 10 份基金份额发放现金红利 0.075 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 3 次利润分配,符合本基金基金合同(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,具体参见报告"7.4.11 利润分配情况"。

(3)本基金的基金管理人于 2018 年 1 月 15 日发布《嘉实多元收益债券型证券投资基金 2017 年第四次收益分配公告》,收益分配基准日为 2017 年 12 月 31 日,本期 A 类份额每 10 份基金份额发放现金红利 0.1120 元,本期 B 类份额每 10 份基金份额发放现金红利 0.1070 元,具体参见本报告"7.4.11 利润分配情况"。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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

本报告期内,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

本报告期内,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 3 次利润分配,分配金额为 16,170,511.90 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 2017 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 2017 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计、注册会计师薛竞、张勇签字出具了"无保留意见的审计报告"(普华永道中天审字(2018)第 22480 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:2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年 12 月 31 日	上年度末 2016年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	2, 340, 665.12	13, 190, 084.22
结算备付金		205, 245.69	903, 181.43
存出保证金		33, 925.15	44, 998.90
交易性金融资产	7.4.7.2	467, 186, 094.53	443, 467, 381.26
其中:股票投资		59, 180, 394.23	16, 216, 395.26
基金投资		-	-
债券投资		408, 005, 700.30	427, 250, 986.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	50, 000, 000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	7, 202, 372.47	7, 583, 580.20
应收股利		-	-
应收申购款		24, 107.47	39, 876.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		476, 992, 410.43	515, 229, 102.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年 12 月 31 日	上年度末 2016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		30, 000, 000.00	-
应付证券清算款		-	1, 023, 590.80
应付赎回款		114, 590.42	716, 484.88
应付管理人报酬		266, 196.51	308, 088.94
应付托管费		76, 056.12	88, 025.40
应付销售服务费		20, 686.71	31, 463.18
应付交易费用	7.4.7.7	101, 746.82	107, 127.01
应交税费		-	-
应付利息		41, 699.88	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	370, 043.17	370, 012.98
负债合计		30, 991, 019.63	2, 644, 793.19
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	382, 432, 152.36	440, 446, 838.45
未分配利润	7.4.7.10	63, 569, 238.44	72, 137, 470.64
所有者权益合计		446, 001, 390.80	512, 584, 309.09
负债和所有者权益总计		476, 992, 410.43	515, 229, 102.28

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日,嘉实多元债券 A 份额净值 1.168 元,基金份额总额 313,357,769.49 份;嘉实多元债券 B 份额净值 1.158 元,基金份额总额 69,074,382.87 份。基金份额总额合计为 382,432,152.36 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:2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2017年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		23, 709, 927.33	- 1, 664, 078.77
1.利息收入		19, 777, 818.69	13, 762, 374.69
其中:存款利息收入	7.4.7.11	82, 629.96	133, 016.53
债券利息收入		18, 582, 908.64	13, 474, 072.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1, 112, 280.09	155, 285.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		4, 641, 322.63	- 7, 101, 125.30
其中:股票投资收益	7.4.7.12	4, 679, 409.26	- 11, 080, 235.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	- 171, 733.78	3, 658, 420.93
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	133, 647.15	320, 689.29
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	- 713, 775.07	- 8, 334, 248.21
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	4, 561.08	8, 920.05
减:二、费用		6, 312, 326.54	5, 298, 033.99
1. 管理人报酬		3, 299, 768.38	2, 299, 132.33
2. 托管费		942, 790.93	656, 894.95
3. 销售服务费		291, 082.44	463, 967.49
4. 交易费用	7.4.7.18	368, 155.50	661, 758.43
5. 利息支出		989, 426.33	795, 068.36
其中:卖出回购金融资产支出		989, 426.33	795, 068.36
6. 其他费用	7.4.7.19	421, 102.96	421, 212.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		17, 397, 600.79	- 6, 962, 112.76
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		17, 397, 600.79	- 6, 962, 112.76

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:2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2017年 1 月 1 日 至 2017 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)	440, 446, 838.45	72, 137, 470.64	512, 584, 309.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	17, 397, 600.79	17, 397, 600.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	- 58, 014, 686.09	- 9, 020, 071.10	- 67, 034, 757.19
其中:1.基金申购款	18, 473, 559.81	2, 878, 795.30	21, 352, 355.11
2.基金赎回款	- 76, 488, 245.90	- 11, 898, 866.40	- 88, 387, 112.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	- 16, 945, 761.89	- 16, 945, 761.89
五、期末所有者权益(基金净值)	382, 432, 152.36	63, 569, 238.44	446, 001, 390.80

项目	上年度可比期间 2016年 1 月 1 日 至 2016 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)	381, 342, 097.72	75, 796, 938.69	457, 139, 036.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	- 6, 962, 112.76	- 6, 962, 112.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	59, 104, 740.73	13, 356, 246.89	72, 460, 987.62
其中:1.基金申购款	417, 650, 828.01	71, 944, 456.43	489, 595, 284.44
2.基金赎回款	- 358, 546, 087.28	- 58, 588, 209.54	- 417, 134, 296.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	- 10, 053, 602.18	- 10, 053, 602.18
五、期末所有者权益(基金净值)	440, 446, 838.45	72, 137, 470.64	512, 584, 309.09

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:

经雷	王红	张公允
基金管理人负责人	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(2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日)及上年度可比期间(2016 年 1 月 1 日至 2016 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 2017