

# 嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）起至 2020 年 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|             |  |                 |
|-------------|--|-----------------|
| 基金简称        | 嘉实中证 500 指数增强  |                 |
| 基金主代码       | 008778   |                 |
| 基金运作方式      | 契约型开放式   |                 |
| 基金合同生效日     | 2020 年 1 月 20 日  |                 |
| 报告期末基金份额总额  | 294,475,451.41 份   |                 |
| 投资目标        | 本基金作为增强指数型基金，采取量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求有效跟踪标的指数，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。                 |                 |
| 投资策略        | 本基金作为增强指数型基金，以跟踪中证 500 指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析，根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过对基本面的深入研究谋求基金在偏离风险及超额收益间的最佳配置。 |                 |
| 业绩比较基准      | 中证 500 指数收益率×95% + 银行活期存款税后利率×5%   |                 |
| 风险收益特征      | 本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。  |                 |
| 基金管理人       | 嘉实基金管理有限公司   |                 |
| 基金托管人       | 中信建投证券股份有限公司   |                 |
| 下属分级基金的基金简称 | 嘉实中证 500 指数增强 A  | 嘉实中证 500 指数增强 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 008778   | 008779          |

|                     |                  |                  |
|---------------------|------------------|------------------|
| 报告期末下属分级基金的份<br>额总额 | 123,148,265.62 份 | 171,327,185.79 份 |
|---------------------|------------------|------------------|

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标              | 报告期(2020年1月20日 - 2020年3月31日) | 报告期(2020年1月20日 - 2020年3月31日) |
|---------------------|------------------------------|------------------------------|
|                     | 嘉实中证 500 指数增强 A              | 嘉实中证 500 指数增强 C              |
| 1. 本期已实现收益          | 10,400,296.44                | 10,666,937.32                |
| 2. 本期利润             | -416,121.61                  | 3,582,169.99                 |
| 3. 加权平均基金份<br>额本期利润 | -0.0026                      | 0.0184                       |
| 4. 期末基金资产净<br>值     | 117,816,330.27               | 163,779,530.38               |
| 5. 期末基金份额净<br>值     | 0.9567                       | 0.9559                       |

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）嘉实中证 500 指数增强 A 收取认（申）购费用和赎回费，嘉实中证 500 指数增强 C 不收取认（申）购费用但收取赎回费、计提销售服务费；（3）上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；（4）本基金合同生效日为 2020 年 1 月 20 日，本报告期自 2020 年 1 月 20 日起至 2020 年 3 月 31 日止。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

嘉实中证 500 指数增强 A

| 阶段    | 净值增长<br>率① | 净值增长<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -4.33%     | 1.87%             | -8.03%             | 2.37%                     | 3.70% | -0.50% |

嘉实中证 500 指数增强 C

| 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 | -4.41% | 1.87%     | -8.03%     | 2.37%         | 3.62% | -0.50% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

嘉实中证500指数增强A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



图 1：嘉实中证 500 指数增强 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

(2020 年 1 月 20 日至 2020 年 3 月 31 日)

**嘉实中证500指数增强C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**



图 2：嘉实中证 500 指数增强 C 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

(2020 年 1 月 20 日至 2020 年 3 月 31 日)

注：本基金基金合同生效日 2020 年 1 月 20 日至报告期末未满 1 年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日 6 个月为建仓期，本报告期处于建仓期内。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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 |        |  |
| 龙昌伦 | 本基金、嘉实对冲套利定期混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实长青竞争优势股票基金经理 | 2020 年 1 月 20 日 | -    | 6 年    | 曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于量化投资部。 |

注：（1）基金经理的任职日期是指本基金基金合同生效之日；（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 管理人对报告期内基金运作合规守信情况的说明

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、

《嘉实中证 500 指数增强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 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，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，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；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投资组合。

#### 4.3.2 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 1 次，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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，受新冠肺炎疫情和油价波动冲击，全球金融市场剧烈动荡。国内 A 股波动率短期剧烈上升，风格切换频繁，上证综指下跌，而代表成长股的创业板指录得小幅上涨。

美股出现多次熔断、多国股市快速下跌以及国内金融市场显著波动，一方面是海外疫情持续升级和原油价格暴跌的事件性冲击，也与过去几年低利率环境下，金融行业持续上升的高杠杆在高波动中被动去杠杆引发的连锁反应有着密切关系，而危机中，逆全球化趋势抬头和经济衰退的预期则进一步加剧了投资者对未来的担忧。在这样的背景中，股票市场的赚钱效应急剧萎缩，国内市场原本相对清晰的主线被打乱，直至 3 月末，在各国央行一系列宽松和提供流动性措施下，市场才得以逐步稳定，投资逻辑有所回归，也使得部分优质资产性价比更高，从长周期看，投资价值进一步上升。

一季度，投资者对受疫情影响较大的消费、餐饮旅游及交运较为谨慎，投资方向和热点集中于医药和科技类股票，包括在线教育、远程办公、半导体、游戏和 5G 等板块，而对宏观经济刺激的预期，使得地产和建筑等有短期表现，市场整体风格上，高成长显著占优。行业方面，农业、医药、计算机和通信等涨幅居前，休闲服务、采掘、家电和非银金融则表现靠后。

本基金主要利用全市场多因子选股模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。报告期内，基金均匀建仓并积极利用市场波动，尽可能降低建仓成本，后期则维持稳定仓位，以获取超额收益为核心。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.9567 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.33%；截至本报告期末嘉实中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 0.9559 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.41%；业绩比较基准收益率为-8.03%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                        | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|---------------------------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资                      | 245,080,636.93 | 86.04        |
|    | 其中：股票                     | 245,080,636.93 | 86.04        |
| 2  | 基金投资                      | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资                    | 1,846,002.50   | 0.65         |
|    | 其中：债券                     | 1,846,002.50   | 0.65         |
|    | 资产支持<br>证券                | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资                     | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资                   | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产                  | -              | -            |
|    | 其中：买断式回<br>购的买入返售金<br>融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算<br>备付金合计          | 33,319,074.93  | 11.70        |
| 8  | 其他资产                      | 4,605,077.86   | 1.62         |
| 9  | 合计                        | 284,850,792.22 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -       | -            |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| B | 采矿业              | 9,065,171.00   | 3.22  |
| C | 制造业              | 106,245,413.00 | 37.73 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 8,967,975.00   | 3.18  |
| E | 建筑业              | 1,548,953.00   | 0.55  |
| F | 批发和零售业           | 12,803,877.00  | 4.55  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,244,841.00   | 2.22  |
| H | 住宿和餐饮业           | 714,195.00     | 0.25  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 18,613,033.00  | 6.61  |
| J | 金融业              | 11,016,210.00  | 3.91  |
| K | 房地产业             | 9,485,481.40   | 3.37  |
| L | 租赁和商务服务业         | 505,352.00     | 0.18  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 798,200.00     | 0.28  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -     |
| P | 教育               | 1,943,408.25   | 0.69  |
| Q | 卫生和社会工作          | 4,940,383.00   | 1.75  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 5,508,228.00   | 1.96  |
| S | 综合               | 417,120.00     | 0.15  |
|   | 合计               | 198,817,840.65 | 70.60 |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,213,130.00  | 0.79         |
| B  | 采矿业              | 1,371,327.00  | 0.49         |
| C  | 制造业              | 28,124,264.30 | 9.99         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 1,563,130.00  | 0.56         |
| F  | 批发和零售业           | 691,488.00    | 0.25         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,050,225.00  | 0.37         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 9,030,849.00  | 3.21         |
| J  | 金融业              | 1,390,790.00  | 0.49         |
| K  | 房地产业             | 810,040.00    | 0.29         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |



|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | 17,552.98     | 0.01  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 46,262,796.28 | 16.43 |

### 5.3 报告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

#### 5.3.1 报告期末指数投资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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 000027 | 深圳能源 | 773,250 | 4,160,085.00 | 1.48         |
| 2  | 300014 | 亿纬锂能 | 66,300  | 3,852,693.00 | 1.37         |
| 3  | 600901 | 江苏租赁 | 749,800 | 3,816,482.00 | 1.36         |
| 4  | 600557 | 康缘药业 | 280,300 | 3,767,232.00 | 1.34         |
| 5  | 600763 | 通策医疗 | 34,400  | 3,707,632.00 | 1.32         |
| 6  | 002013 | 中航机电 | 498,900 | 3,597,069.00 | 1.28         |
| 7  | 600967 | 内蒙一机 | 374,300 | 3,409,873.00 | 1.21         |
| 8  | 600985 | 淮北矿业 | 413,000 | 3,398,990.00 | 1.21         |
| 9  | 000848 | 承德露露 | 475,600 | 3,362,492.00 | 1.19         |
| 10 | 600917 | 重庆燃气 | 508,200 | 3,221,988.00 | 1.14         |

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 300043 | 星辉娱乐 | 629,900 | 2,450,311.00 | 0.87         |
| 2  | 002204 | 大连重工 | 731,000 | 2,149,140.00 | 0.76         |
| 3  | 002130 | 沃尔核材 | 438,800 | 1,935,108.00 | 0.69         |
| 4  | 601012 | 隆基股份 | 73,130  | 1,816,549.20 | 0.65         |
| 5  | 300498 | 温氏股份 | 49,600  | 1,602,080.00 | 0.57         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
| 1  | 国家债券 | -       | -            |

|    |           |              |      |
|----|-----------|--------------|------|
| 2  | 央行票据      | -            | -    |
| 3  | 金融债券      | 1,800,402.50 | 0.64 |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,800,402.50 | 0.64 |
| 4  | 企业债券      | -            | -    |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -    |
| 6  | 中期票据      | -            | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | 45,600.00    | 0.02 |
| 8  | 同业存单      | -            | -    |
| 9  | 其他        | -            | -    |
| 10 | 合计        | 1,846,002.50 | 0.66 |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 数量(张)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 018007 | 国开 1801 | 17,870 | 1,800,402.50 | 0.64         |
| 2  | 128099 | 永高转债    | 456    | 45,600.00    | 0.02         |

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

### 5.6 报告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

无。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称     | 持仓量<br>(买/卖) | 合约市值(元)       | 公允价值变动<br>(元) | 风险说明        |
|-------------------|--------|--------------|---------------|---------------|-------------|
| IC2004            | IC2004 | 18           | 17,889,840.00 | -202,960.00   | -           |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |              |               |               | -202,960.00 |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |              |               |               | -           |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |              |               |               | -202,960.00 |

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 2019 年 9 月 25 日，江苏银保监局发布行政处罚信息公开表（苏银保监罚决字【2019】18 号），对江苏金融租赁股份有限公司以公益性资产作为租赁物、违规提供融资等违法违规事实，于 2019 年 9 月 16 日作出行政处罚决定，罚款人民币 50 万元。

本基金投资于“江苏租赁（600901）”的决策程序说明：基于对江苏租赁基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“江苏租赁”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

##### 5.11.2

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。

##### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,537,501.88 |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,893,853.19 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 50,964.92    |
| 5  | 应收申购款   | 122,757.87   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,605,077.86 |

##### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

##### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

###### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 嘉实中证 500 指数增强 A | 嘉实中证 500 指数增强 C |
|---------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日（2020 年 1 月 20 日）持有的基金份额 | 196,864,056.96  | 258,838,029.97  |
| 报告期期间基金总申购份额                    | 10,082,060.12   | 71,624,193.57   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                  | 83,797,851.46   | 159,135,037.75  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -               | -               |
| 报告期期末基金份额总额                     | 123,148,265.62  | 171,327,185.79  |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |      |               |      | 报告期末持有基金情况    |          |
|-------|----------------|-------------------------|------|---------------|------|---------------|----------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额          | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比 (%) |
| 机构    | 1              | 2020/03/19 至 2020/03/31 | -    | 61,377,691.97 | -    | 61,377,691.97 | 20.84    |

|  |   |   |   |   |   |   |
|--|---|---|---|---|---|---|
| 个人   | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险   |   |   |   |   |   |   |
| <p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> |   |   |   |   |   |   |

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 500 指数增强型证券投资基金公告的各项原稿。

### 9.2 存放地点

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

### 9.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2020 年 4 月 22 日