

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 景顺长城沪深 300 指数增强 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 000311 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 10 月 29 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,725,550,015.43 份 |
| 投资目标 | 本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的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，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略:本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略:本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略:出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、权证、股指期货投资策略:本基金可投资股指期货和其他经中国证</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成分股、备选成分股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>5、中小企业私募债券的投资策略：对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。</p> |
| 业绩比较基准 | 95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

§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（2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 693,349,154.31 |
| 2. 本期利润 | 161,706,141.65 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0863 |
| 4. 期末基金资产净值 | 4,864,952,682.09 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.819 |

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、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。

3.2 基金净值表现

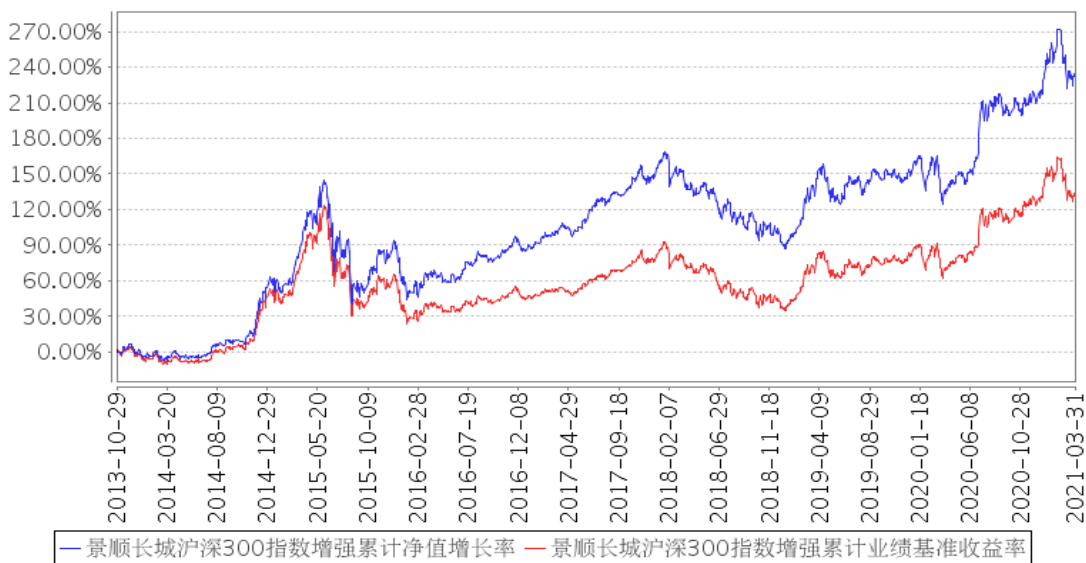
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.79% | 1.53% | -2.58% | 1.52% | 3.37% | 0.01% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | 10.29% | 1.27% | 10.39% | 1.26% | -0.10% | 0.01% |
| 过去一年 | 41.80% | 1.28% | 36.97% | 1.26% | 4.83% | 0.02% |
| 过去三年 | 38.05% | 1.34% | 34.12% | 1.31% | 3.93% | 0.03% |
| 过去五年 | 100.79% | 1.16% | 65.91% | 1.12% | 34.88% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 231.50% | 1.48% | 131.66% | 1.40% | 99.84% | 0.08% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

景顺长城沪深300指数增强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



注：本基金的资产配置比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 10 月 29 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§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 | | |
| 黎海威 | 本基金的 | 2013 年 10 月 | - | 18 年 | 经济学硕士，CFA。曾担任美国穆迪 KMV |

| | | | | | |
|--|--------------------------|------|--|--|---|
| | 基金经理、公司副总经理兼量化及指数投资部投资总监 | 29 日 | | | 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部投资总监，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现担任公司副总经理兼量化及指数投资部投资总监兼量化及指数投资部基金经理。 |
|--|--------------------------|------|--|--|---|

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，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% 的交易共有 3 次，为投资组合的投资策略需要而发生的

同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年一季度，随着发达国家疫苗接种率的快速提升，全球疫情逐步得到有效控制，中国作为疫情最早得到控制的经济体，各项经济指标持续修复，1-3 月国内制造业 PMI 依次为 51.3、50.6、51.9，受去年基数影响，1-2 月工业增加值累计同比上升 35.1%。2 月 PPI 同比上升 1.7%，环比上升 0.8%；CPI 同比下降 0.2%，环比上升 0.6%，受美国经济及消费复苏影响，海外大宗商品价格出现大幅上涨，通胀预期上行。2 月 M2 同比增速 10.1%，M1 同比增速 7.4%，2 月末外汇储备 3.20 万亿美元，汇率维持平稳。国内货币政策总体保持稳健，流动性合理适度，追求多目标下的平衡，经济增长、信用风险、通胀、结构性资产价格泡沫等都成为央行关注的要素。一季度 A 股市场出现了大幅波动，美债收益率的快速抬升使得市场估值承受压力，特别是估值较高的核心资产出现连续下跌，而低估值顺周期板块在增长预期和大宗商品涨价带动下出现上涨。一季度，上证综指下跌 0.90%，沪深 300 下跌 3.13%，创业板指下跌 7.00%。

展望 2021 年第二季度，中国经济的复苏仍有惯性，但经济扩张势头边际放缓。全球货币政策在当前方向上“易紧难松”，部分新兴市场国家为应对通胀压力、稳定汇率，已进入加息通道，中国央行态度也可能在“稳”的基础上出现缓慢转弯，我们对宏观场景的判断是“稳货币、紧信用”。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。权益市场经历了这轮快速的估值调整后，逐步出现长期配置机会，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金是以沪深 300 指数为基准的指数增强基金，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 1 季度，本基金份额净值增长率为 0.79%，业绩比较基准收益率为-2.58%。

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 | 4,497,344,513.62 | 90.18 |
| | 其中：股票 | 4,497,344,513.62 | 90.18 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 169,182,851.20 | 3.39 |
| | 其中：债券 | 169,182,851.20 | 3.39 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 167,937,596.12 | 3.37 |
| 8 | 其他资产 | 152,658,721.19 | 3.06 |
| 9 | 合计 | 4,987,123,682.13 | 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境内股票投资组合

| 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 | 39,517,451.68 | 0.81 |
| B | 采矿业 | 46,808,726.64 | 0.96 |
| C | 制造业 | 1,929,215,350.06 | 39.66 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 26,244,489.60 | 0.54 |
| E | 建筑业 | 15,574,338.00 | 0.32 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 41,906,862.40 | 0.86 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 27,865,703.16 | 0.57 |
| J | 金融业 | 1,243,895,713.33 | 25.57 |
| K | 房地产业 | 161,505,060.84 | 3.32 |
| L | 租赁和商务服务业 | 171,961,735.84 | 3.53 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | 35,925,201.00 | 0.74 |
| Q | 卫生和社会工作 | 78,898,113.37 | 1.62 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,819,318,745.92 | 78.51 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | - | - |
| C | 制造业 | 438,404,340.79 | 9.01 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 47,950,341.28 | 0.99 |
| E | 建筑业 | 38,686,110.00 | 0.80 |
| F | 批发和零售业 | 12,819.76 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 73,962,183.46 | 1.52 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 17,174,133.26 | 0.35 |
| J | 金融业 | 1,183,425.93 | 0.02 |
| K | 房地产业 | 10,200.30 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 25,731,309.00 | 0.53 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 33,392.02 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 34,877,511.90 | 0.72 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 678,025,767.70 | 13.94 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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 | 600519 | 贵州茅台 | 135,008 | 271,231,072.00 | 5.58 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 3,180,930 | 250,339,191.00 | 5.15 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 3,580,654 | 182,971,419.40 | 3.76 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 1,720,818 | 141,502,864.14 | 2.91 |
| 5 | 600309 | 万华化学 | 1,264,959 | 133,579,670.40 | 2.75 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 26,661,588 | 131,974,860.60 | 2.71 |
| 7 | 600809 | 山西汾酒 | 370,409 | 123,272,115.20 | 2.53 |
| 8 | 601939 | 建设银行 | 15,051,000 | 110,624,850.00 | 2.27 |
| 9 | 002736 | 国信证券 | 8,840,532 | 105,732,762.72 | 2.17 |
| 10 | 601888 | 中国中免 | 322,047 | 98,572,145.76 | 2.03 |

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 | 002020 | 京新药业 | 5,484,500 | 63,784,735.00 | 1.31 |
| 2 | 600461 | 洪城水业 | 6,859,970 | 47,882,590.60 | 0.98 |
| 3 | 603882 | 金域医学 | 274,518 | 34,877,511.90 | 0.72 |
| 4 | 601865 | 福莱特 | 1,352,722 | 33,452,815.06 | 0.69 |
| 5 | 600808 | 马钢股份 | 10,237,601 | 32,760,323.20 | 0.67 |

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 | 140,182,000.00 | 2.88 |
| | 其中：政策性金融债 | 140,182,000.00 | 2.88 |
| 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） | 29,000,851.20 | 0.60 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 169,182,851.20 | 3.48 |

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 | 200216 | 20 国开 16 | 1,400,000 | 140,182,000.00 | 2.88 |
| 2 | 113042 | 上银转债 | 228,320 | 23,096,851.20 | 0.47 |
| 3 | 113045 | 环旭转债 | 59,040 | 5,904,000.00 | 0.12 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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、2020 年 4 月 20 日，中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”，股票代码：601939、0939.HK）因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕8 号），被处以罚款人民币 230 万元。

2020 年 7 月 13 日，建设银行因内控管理不到位、支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件等多项问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》的相关规定，收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕32 号），被处以罚款人民币 3920 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程

序对建设银行进行了投资。

2、交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”，股票代码：601328、3328.HK）于 2020 年 7 月 28 日收到上海银保监局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字（2020）8 号）。其信用卡中心因某客户个人信息未尽安全保护义务、对部分信用卡催收外包管理严重不审慎，被处以 100 万元罚款。

2020 年 4 月 20 日，交通银行因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第 47 条等规定，收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字（2020）6 号），被处以 260 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对交通银行进行了投资。

3、中国平安保险（集团）股份有限公司（以下简称“中国平安”，股票代码：601318）因其子公司中国平安财产保险股份有限公司于 2020 年 8 月 6 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字（2020）58 号）。其因未按车辆实际使用性质承保商业车险行为违反了《保险法》第一百三十五条的规定，被罚款 50 万元。手续费支出未分摊至各分支机构行为违反了《保险法》第八十六条的规定，被罚款 25 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中国平安进行了投资。

4、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）于 2020 年 7 月 28 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字（2020）7 号）。其信用卡中心因某客户个人信息未尽安全保护义务、对部分信用卡催收外包管理严重不审慎，被处以 100 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行进行了投资。

5、国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字（2020）67 号）。其因为违规的政府购买服务项目提供融资等多项违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则规定，被处以罚款 4880 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对国家开发银行债券进行了投资。

6、上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”，股票代码：601229）于 2020 年 11 月 18

日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书(沪银保监银罚决字(2020)25号)。其因2014年至2018年绩效考评管理严重违反审慎经营规则、2018年未按规定延期支付2017年度绩效薪酬等问题,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项、《中国银行业监督管理委员会关于印发银行业金融机构绩效考评监管指引的通知》(银监发(2012)34号)第三十二条、《商业银行稳健薪酬监管指引》(银监发(2010)14号)第二十五条的相关规定,被处以罚款人民币80万元。

2020年8月14日,上海银行违规向资本金不足、“四证”不全的房地产项目发放贷款,以其他贷款科目发放房地产开发贷款、并购贷款管理严重违反审慎经营规则、经营性物业贷款管理严重违反审慎经营规则等原因,违反了《中华人民共和国商业银行法》第七十三条、第七十四条、第八十条,《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十七条等规定,收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书(沪银保监银罚决字(2020)14号),被处以没收违法所得27.155092万元,罚款1625万元,罚没合计1652.155092万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对上海银行进行了投资。

7、其余四名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,386,172.16 |
| 2 | 应收证券清算款 | 143,060,682.29 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,027,232.47 |
| 5 | 应收申购款 | 6,184,634.27 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 152,658,721.19 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 601865 | 福莱特 | 33,452,815.06 | 0.69 | 非公开流通受限 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,413,006,459.22 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 421,213,335.34 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,108,669,779.13 |
| 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 | 1,725,550,015.43 |

注：总申购份额含转换入份额，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

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

§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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》等

法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，我司对旗下包括本基金在内的 15 只基金的基金合同等法律文件进行修订。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2021 年 3 月 29 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2021 年 4 月 22 日