

# 上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资 基金清算报告

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：[2018]年[11]月[12]日

清算报告公告日：[2019]年[1]月[18]日

## 一、重要提示及目录

### 1、重要提示

上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可[2012] 103 号文核准募集，于[2012]年[6]月[12]日成立并正式运作，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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》和《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，提议终止上市并终止《基金合同》。本基金基金份额持有人大会以现场开会方式召开，现场会议召开时间为自[2018]年[10]月[25]日，由参加会议的基金份额持有人对本次持有人大会审议事项进行表决。本基金管理人于[2018]年[10]月[25]日在公证人、见证律师、基金托管人、基金份额持有人及其代理人的监督下对本次持有人大会表决进行了计票，会议审议通过了《关于上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金终止上市并终止基金合同有关事项的议案》，决定终止上市并终止《基金合同》。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见刊登在[2018]年[10]月[26]日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站（<http://www.igwfm.com>）上的《景顺长城基金管理有限公司关于上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金清算期为 15 天，即[2018]年[10]月[29]日至[2018]年[11]月[12]日。由基金管理人景顺长城基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于[2018]年[10]月[29]日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 2、目录

一、重要提示及目录.....	2
1、重要提示.....	2
2、目录.....	3
二、基金概况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清盘事项说明.....	6
1、基本情况.....	6
2、清算原因.....	7
3、清算起始日.....	7
4、清算报表编制基础.....	7
五、清算情况.....	7
六、备查文件目录.....	9
1、备查文件目录.....	9
2、存放地点.....	9
3、查阅方式.....	10

## 二、基金概况

1、基金名称：上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金。基金简称：景顺长城上证 180 等权重 ETF。场内简称：180EWETF。基金代码：510420

2、基金运作方式：交易型开放式

3、基金合同生效日：[2012]年[6]月[12]日

4、投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

5、投资策略：

### （1）股票资产指数化投资策略

本基金以上证 180 等权重指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。

### （2）债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以内的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

### （3）权证投资策略

本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

6、业绩比较基准：上证 180 等权重指数

7、风险收益特征：本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金为指数型基

金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

8、基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

9、基金托管人：中国银行股份有限公司

### 三、财务会计报告

基金清算截止日资产负债表（经审计）

会计主体：上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 11 月 12 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 11 月 12 日(基金清算截止日)
<b>资 产：</b>	
银行存款	9,497,419.09
结算备付金	58,899.59
存出保证金	5,468.61
交易性金融资产	178,996.72
其中：股票投资	178,996.72
应收证券清算款	270,357.36
应收利息	3,842.77
<b>资产合计：</b>	<b>10,014,984.14</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负债：</b>	
应付交易费用	17,247.40
其他负债	199,130.43
<b>负债合计</b>	<b>216,377.83</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	8,655,541.00
未分配利润	1,143,065.31

所有者权益合计	9,798,606.31
负债与持有人权益总计:	10,014,984.14

注：报告截止日2018年11月12日(基金清算截止日)，基金份额净值为1.132元，基金份额总额为8,655,541.00份。

## 四、清盘事项说明

### 1、基本情况

上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]103号文《关于核准上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》的核准，由基金管理人景顺长城基金管理有限公司作为发起人于[2012]年[5]月[2]日至[2012]年[6]月[6]日向社会公开募集，募集期结束经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于[2012]年[6]月[12]日正式生效，首次设立募集规模为人民币 1,270,455,541.00 元，折合 1,270,455,541.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为：本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合法律法规或监管机构的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金还可以投资于中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会于[2018]年[10]月[25]日表决通过了《关于上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金终止上市并终止基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。根据持有人大会通过的议案及议案说明，本基金从[2018]年[10]月[29]日起进入清算期，清算期截止至[2018]年[11]月[12]日当日，共 15 天。

## 2、清算原因

本基金基金份额持有人大会通过《关于上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金终止上市并终止基金合同有关事项的议案》。

## 3、清算起始日

根据[2018]年[10]月[25]日本基金基金份额持有人大会通过的议案及议案说明，本基金于[2018]年[10]月[29]日起进入清算期，清算截止日为[2018]年[11]月[12]日。

## 4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 五、清算情况

自2018年10月29日至2018年11月12日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行了清算后，截止2018年11月12日本基金的资产负债具体情况如下：

### （一）清算费用

按照《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》“二十六、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### （二）资产情况

（1）本基金截至清算截止日的银行存款余额为人民币9,497,419.09元，该款项由基金托管人负责保管；

（2）本基金截至清算截止日结算备付金余额为人民币 58,899.59 元，存出保证金余额为人民币 5,468.61 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（以下或简称“登记公司”）收取并保管。本基金基金管理人景顺长城基金管理有限公司拟以自有资金先行垫付于剩余财产划付日尚未收回的的结算备付金及存出保证

金，供清盘分配使用，基金管理人垫付的资金待登记公司返还后再归还基金管理人。因登记公司于每月第二个工作日根据基金上月的交易情况对其收取的结算备付金及存出保证金进行调整，基金管理人具体垫付的金额，以剩余财产划付日登记公司实际收取的金额为准。

(3) 本基金截至清算截止日交易性金融资产为人民币 178,996.72 元，均为截止该日本基金持有的流通受限股票，明细如下：

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	估值单价 (人民币元)	估值金额 (人民币元)
1	600485	信威集团	16,823	10.64	178,996.72

基金管理人将在股票复牌时对其进行变现处置，具体处置原则为：

①若截止剩余财产划付日该股票已复牌，以本基金于股票复牌变现时取得资金的净额纳入剩余财产，供清盘分配使用；

②若截止剩余财产划付日该股票继续停牌，则不纳入一次剩余财产分配，基金管理人将待其复牌变现后，按照上述处置标准，将变现资金净额以二次清算的形式归还投资者。

(4) 本基金截至清算截止日应收证券清算款为人民币 270,357.36 元，该款项为本基金于 2018 年 11 月 12 日（清算截止日）卖出股票后形成的应收证券清算款。根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的交收规则，该资金已于股票卖出次日（2018 年 11 月 13 日）划回基金托管账户，由基金托管人负责保管。

(5) 本基金截至清算截止日应收利息为人民币 3,842.77 元，由应收银行存款利息人民币 3,810.65 元，应收结算备付金利息人民币 28.30 元，应收存出保证金利息人民币 3.82 元构成。本基金基金管理人景顺长城基金管理有限公司拟以自有资金先行垫付于剩余财产划付日尚未收回的的应收利息，供清盘分配使用，基金管理人垫付的资金结息日收回后再归还基金管理人。根据中国人民银行的利息结算规则，基金管理人具体垫付的金额，以上一结息日至剩余财产划付日计算的应收利息为准。

### (三) 负债情况

(1) 本基金截至清算截止日应付交易费用为人民币 17,247.40 元，均为交易所市场应付交易费用。该款项分别由本基金运作期内产生的尚未支付的应付交易费用 16,894.51 元和 2018 年 10 月 29 日至 2018 年 11 月 12 日（基金清算期间）变现股票产生的应付交易费用 352.89 元构成。其中基金正常运作期间产生的交易费用已于 2018 年 11 月



21日支付；因本基金持有流通受限的股票尚未能全部变现，故基金清算期间产生的应付交易费用将于所有股票清理变现后一次性支付。

(2) 本基金截至清算截止日其他负债为人民币199,130.43元，由应付指数使用费、预提审计费用、信息披露费分别构成。

1) 应付指数使用费为人民币14,130.43元，为基金正常运作期2018年10月1日至2018年10月26日（基金最后运作日）使用“上证180等权重指数”需缴纳的指数使用费，该部分费用待收到中证指数有限公司缴款通知后缴纳；

2) 预提信息披露费合计为人民币150,000.00元，分别为预提中国证券报、上海证券报及证券时报三家媒体信息披露费各50,000.00元，该部分费用待收到三家媒体的付款通知后支付；

3) 预提审计费用为人民币35,000.00元，该部分费用为应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费，待其完成本基金的审计业务后支付。

#### (四) 剩余资产分配情况

截止2018年11月12日（本基金清算截止日）本基金剩余财产为人民币9,798,606.31元，根据本基金的《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算截止日至剩余财产划付日期间产生的银行汇划费亦由基金份额持有人承担。

#### (五) 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- (1) 上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金资产负债表及审计报告；
- (2) 《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金财产清算小组

[2018]年[11]月[12]日