

上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金
清算报告

2015年11月10日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

公告日期：2015年12月4日

一、重要提示

上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“百强ETF”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】125号文核准募集，于2013年4月24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，为更好地满足投资者需求，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《上证市值百强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，提议本基金终止上市并终止《基金合同》。百强ETF已于2015年10月12日在北京以现场开会方式召开基金份额持有人大会，并表决通过了《关于上证市值百强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2015年10月13日《证券时报》、上海证券交易所网站和基金管理人网站上的《上证市值百强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》。

本基金从2015年10月14日起进入清算期，由基金管理人长盛基金管理有限公司、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2015年10月13日组成基金财产清算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。

二、基金概况

1、基金名称：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金（基金简称：长盛上证市值百强ETF，场内简称：百强ETF，基金代码：510700）

2、基金运作方式：交易型开放式

3、基金合同生效日：2013年4月24日

4、2015年10月13日基金份额总额：4,213,677.00份

5、投资目标：本基金跟踪投资标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期收益。

6、标的指数：上证市值百强指数

7、投资策略：本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

7、业绩比较基准：上证市值百强指数

8、风险收益特征：本基金为被动式投资的股票指数型基金，预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合风险收益特征相近，属于高风险、高收益的基金品种。

9、基金管理人：长盛基金管理有限公司

10、基金托管人：中国银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金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【2013】125号文《关于核准上证市值百强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》核准，由基金管理人长盛基金管理有限公司于2013年4月1日至2013年4月17日向社会公开发行募集，基金合同于2013年4月24日正式生效，首次设立募集规模为622,680,523.00份基金份额。自2013年4月24日至2015年10月13日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，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《基金合同》的有关规定，提议本基金终止上市并终止《基金合同》。百强ETF已于2015年10月12日在北京以现场开会方式召开基金份额持有人大会，并表决通过了《关于上证市值百强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》。本基金从2015年10月14日起进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015年10月13日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2015年10月13日
资 产：	
银行存款	366,060.91
结算备付金	12,777.23
存出保证金	286.57
股票投资	909,315.20
应收利息	171.19
应收申购款	0.00
应收证券清算款	9,773,095.83
资产总计	11,061,706.93
负 债：	
应付管理人报酬	2,007.94
应付托管费	401.59
应付赎回款	0.00
应付交易费用	11,722.44
其他应付款	57,065.22
预提费用	70,000.00
负债合计	141,197.19
所有者权益：	
实收基金	7,578,483.38
未分配利润	3,342,026.36

所有者权益合计	10,920,509.74
负债和所有者权益总计	11,061,706.93

五、清算情况

自2015年10月14日至2015年11月10日止清算期间，基金财产清算组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》中“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组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人代为支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币12,777.23元，已于2015年11月3日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币286.57元，已由基金管理人长盛基金管理有限公司于2015年11月6日以自有资金垫付至托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币171.19元，已由基金管理人长盛基金管理有限公司于2015年11月6日以自有资金垫付至托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币9,773,095.83元，已于2015年10月14日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日持有的股票资产为人民币909,315.20元（最后运作日估值金额），均为最后运作日停牌股票。

①本基金最后运作日（2015年10月13日）持有的全部停牌股票明细为：

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	停牌价格 (人民币元)	最后运作日估值金额 (人民币元)
1	600100	同方股份	3,600	15.60	56,160.00
2	600104	上汽集团	7,000	17.77	124,390.00
3	600271	航天信息	1,500	55.91	83,865.00
4	600739	辽宁成大	3,000	15.83	47,490.00
5	600893	中航动力	1,300	40.86	53,118.00
6	600900	长江电力	13,700	14.35	196,595.00
7	601169	北京银行	20,860	8.77	182,942.20
8	601618	中国中冶	12,500	7.79	97,375.00
9	601727	上海电气	6,000	11.23	67,380.00
合计					909,315.20

②清算期间（2015年10月14日至2015年11月10日）复牌股票的处置情况：

1) 中航动力（代码：600893）

2015年10月14日复牌，2015年10月15日卖出1,300股，卖出所得金额61,755.00元。

2) 同方股份（代码：600100）

2015年10月26日复牌，2015年10月27日卖出3,600股，卖出所得金额64,264.92元。

3) 上汽集团（代码：600104）

2015年11月6日复牌，截止清算期结束日2015年11月10日尚未卖出。

③截止清算期结束日（2015年11月10日），本基金仍持有的股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	停牌价格 (人民币元)	最后运作日估值金额 (人民币元)
1	600104	上汽集团	7,000	17.77	124,390.00
2	600271	航天信息	1,500	55.91	83,865.00
3	600739	辽宁成大	3,000	15.83	47,490.00
4	600900	长江电力	13,700	14.35	196,595.00
5	601169	北京银行	20,860	8.77	182,942.20
6	601618	中国中冶	12,500	7.79	97,375.00
7	601727	上海电气	6,000	11.23	67,380.00
合计					800,037.20

根据本基金2015年9月8日发布的《关于以现场开会方式召开上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》中附件三《关于上证市值百强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说明》约定，基金进入清算程序后，如有持仓股票停牌，为了最大化保护基金份额持有人利益，提高清算效率，基金管理人将以自有资金按照基金所持有股票资产的停牌价格垫付基金未能变现的股票资产。

截止清算期结束日，本基金持有的股票中，上汽集团（代码：600104）已于2015年11月6日复牌，但尚未卖出变现。基金管理人以自有资金按照基金所持有股票资产的最后运作日估值金额（即停牌价格*持仓数量）垫付基金未能变现的股票资产，并已于2015年11月6日垫付至托管账户共计800,037.20元。待全部股票复牌处置完毕后，若变现金额高于最后运作日估值金额，则差额归基金份额持有人所有，基金管理人将按基金份额持有人持有的基金份额比例追偿给基金份额持有人；若变现金额低于最后运作日估值金额，则由基金管理人承担相应损失。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币2,007.94元，该款项已于2015年10月23日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币401.59元，该款项已于2015年10月23日支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币11,722.44元，该款项已于2015年11月5日支付。

(4) 本基金最后运作日预提费用为本基金应支付的信息披露费，共计人民币70,000.00元，该款项已于2015年10月23日支付。

(5) 本基金最后运作日其他应付款为本基金应支付的指数使用费，共计人民币57,065.22元，该款项已于2015年10月23日支付。

4、清算日的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2015年10月14日至2015年11月10日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入-银行存款利息收入(注1)	5,498.02
2、股票投资收益(注2)	15,662.07
清算收益小计	21,160.09
二、清算费用	
清算费用小计(注3)	-
三、清算净收益	21,160.09

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2015年10月14日至2015年11月10日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2：股票投资收益为清算期间卖出股票金额与最后运作日估值金额以及因卖出股票所产生的补缴股息红利税金额的差额。

注3：经本基金管理人长盛基金管理有限公司确认，本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2015 年 10 月 13 日基金净资产	10,920,509.74
加：清算期间净收益	21,160.09
二、2015 年 11 月 10 日基金净资产	10,941,669.83

资产处置及负债清偿后，2015年11月10日本基金剩余财产为人民币10,941,669.83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，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日2015年10月14日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有。为便于及时向基金份额持有人分配剩余资产，基金管理人长盛基金管理有限公司以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息及结算备付金等。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

本基金的银行存款应收利息为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中基金管理人垫付资金与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

6、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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金2015年10月13日资产负债表及审计报告

(2) 《上证市值百强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。

上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金财产清算组

2015年11月10日