

上证 180 高贝塔交易型开放式指数证券投资基金 清算报告

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

一、 重要提示

上证 180 高贝塔交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“180ETF”或“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可[2012]1629 号文核准募集,于 2013 年 7 月 8 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 180 高贝塔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》。上证 180 高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会已于 2016 年 6 月 20 日以现场开会方式在上海召开,并表决通过了《关于上证 180 高贝塔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 2016 年 6 月 22 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及上海证券交易所网站和基金管理人网站上的《关于上证 180 高贝塔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 2016 年 6 月 23 日起进入清算期,由基金管理人上投摩根基金管理有限公司、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)和上海源泰律师事务所于 2016 年 6 月 23 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,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、 基金基本情况

- 1、基金名称: 上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金(基金简称: 180高ETF,场内简称: 180高ETF,基金代码: 510450)
- 2、基金运作方式: 交易型开放式
- 3、基金合同生效日: 2013年7月8日

- 4、2016年6月22日基金份额总额：3,920,713.00 份
- 5、投资目标：本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争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不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%，以实现对上证180高贝塔指数的有效跟踪。
- 6、标的指数：上证180高贝塔指数
- 7、投资策略：本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。
- 8、业绩比较基准：上证180高贝塔指数收益率
- 9、风险收益特征：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。
- 10、基金管理人：上投摩根基金管理有限公司
- 11、基金托管人：中国银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金根据中国证券监督管理委员会《关于核准上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]1629号文），由基金管理人上投摩根基金管理有限公司自2013年6月3日至2013年6月28日向全社会公开募集，首次设立募集的有效净认购金额为324,908,013.00元人民币，折合基金份额324,908,013.00份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计12,700元人民币，折合基金份额12,700份。基金合同于2013年7月8日正式生效。自2013年7月8日至2016年6月22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》。已于2016年6月20日以现场开会方式在上海召开，并表决通过了《关于上证180高贝塔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2016年6月23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180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016年6月22日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月22日 (基金最后运作日)	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	5	5,587,673.09	203,869.97
结算备付金		3,519.40	1,510.50
存出保证金		253.79	972.53
交易性金融资产	6	169,297.33	9,066,882.49
其中：股票投资		169,297.33	9,066,882.49
应收利息	7	115.96	43.75
资产总计		5,760,859.57	9,273,279.24
负债和所有者权益			
负债：			
应付证券清算款		2,765.25	-

应付管理人报酬	19(b)	1,695.99	3,930.86
应付托管费	19(c)	339.20	786.19
应付交易费用	8	14,252.29	5,824.27
其他负债	9	151,666.67	55,678.97
负债合计		170,719.40	66,220.29
所有者权益：			
实收基金	10	3,920,713.00	4,920,713.00
未分配利润	11	1,669,427.17	4,286,345.95
所有者权益合计		5,590,140.17	9,207,058.95
负债和所有者权益总计		5,760,859.57	9,273,279.24

注：

1. 报告截止日 2016 年 6 月 22 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.4258 元，基金份额总额 3,920,713.00 份。

2. 财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 22 日(基金最后运作日)。

五、清算情况

自 2016 年 6 月 23 日至 2016 年 7 月 20 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 180 高贝塔交易型开放式指数证券投资基金基金合同》中“二十五、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。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 5,587,673.09 元,截至 2016 年 7 月 20 日(清算截止日) 银行存款为人民币 5,569,101.77 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 3,519.40 元。2016 年 7 月 4 日调整后为人民币 14,984.94 元,上述款项于 2016 年 8 月 2 日归还基金。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 253.79 元。2016 年 7 月 4 日调整后为人民币 7,668.34 元。

(4) 本基金最后运作日应收利息为人民币 115.96 元,截至 2016 年 7 月 20 日(清算截止日) 银行存款为人民币 3,277.03 元。

(5) 本基金最后运作日持有的股票资产为人民币 169,297.33 元,持有如下股票投资:

股票代码	股票名称	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600639	浦东金桥	21.16	4,400	92,183.17	93,104.00
601989	中国重工	6.17	12,349	101,391.25	76,193.33
合计				193,574.42	169,297.33

注:

1.其中停牌股票采用停牌前一交易日股票收盘价估值。

2.在清算期内,待基金管理人将上述股票资产卖出变现后,以卖出股票资产的变现金额计算的实际收益划付给基金份额持有人。

清算期间(2016年6月23日至2016年7月20日)上述股票处置情况:

浦东金桥(代码: 600639), 2016年6月23日卖出4,400股,卖出所得金额90,929.00元。

中国重工(代码: 601989), 2016年6月29日卖出12,349股,卖出所得金额80,515.48元。

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 1,695.99 元,该款项已于 2016 年 7 月 5 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币339.20元, 该款项已于2016年7月5日支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币14,252.29元, 清算期间变现股票资产产生交易费用159.66元, 合计为人民币14,411.95元, 该款项已于2016年7月5日支付。

(4) 本基金最后运作日应付证券清算款为卖出股票应缴股息红利税款, 共计人民币2,765.25元, 该款项已于2016年6月23日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为本基金预提费用, 包含本基金应付审计费、上市费、律师费、指数使用费共计人民币151,666.67元, 上述款项截至2016年7月11日已全部偿还。

4、清算期的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	自2016年6月23日至2016年7月20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)	3,161.07
2、股票投资收益(注2)	1800.84
清算收益小计	4,961.91
二、清算费用	
银行划款手续费	70.00
三、清算净收益	4,891.91

注1: 利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2016年6月23日至2016年7月20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。

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2016年6月22日基金净资产	5,590,140.17
加：清算期间净收益	4,891.91
加：清算截止日至清算款划出期间净收益	1,573.04
二、2016年8月3日基金净资产	5,596,605.12

资产处置及负债清偿后，2016年8月3日本基金剩余财产为人民币5,596,605.12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2016年6月23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，基金管理人上投摩根基金管理有限公司于2016年8月3日以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息及存出保证金等。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、备查文件目录

1.备查文件目录

(1)上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金2016年6月22日资产负债表及审计报告

(2)《上证180高贝塔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

基金管理人处

3.查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

上证180高贝塔交易型开放式指数证券投资基金财产清算组

2016年8月4日