

# 景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指 数证券投资基金联接基金 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[5]月[29]日

清算报告公告日：[2018]年[7]月[23]日

## 一、重要提示及目录

### 1、重要提示

景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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[25]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《景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金基金份额持有人大会以通讯开会方式召开，大会投票表决起止时间为自[2018]年[3]月[21]日起至[2018]年[4]月[18]日[24]:00 止。本基金管理人于[2018]年[4]月[19]日在公证人、见证律师、托管银行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《关于景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金终止基金合同有关事项的议案》，决定终止《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[4]月[20]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景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接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 37 天，即[2018]年[4]月[23]日至[2018]年[5]月[29]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[4]月[23]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.....	4
四、清算事项说明.....	5
1、基本情况.....	5
2、清算原因.....	6
3、清算起始日.....	6
4、清算报表编制基础.....	6
五、清算情况.....	7
六、备查文件目录.....	11
1、备查文件目录.....	11
2、存放地点.....	11
3、查阅方式.....	11

## 二、基金概况

1、基金名称：景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金。基金简称：景顺长城上证 180 等权重 ETF 联接。基金代码：263001

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：[2012]年[6]月[25]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：本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标。具体投资策略包括资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略等。

6、业绩比较基准：上证 180 等权重指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%

7、风险收益特征：本基金为 ETF 联接基金，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。本基金在股票基金中属于指数基金，紧密跟踪标的指数，属于股票基金中风险较高、收益与标的指数所代表的股票市场水平大致相近的产品。

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

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2018 年 4 月 20 日

单位：人民币元

资产	本期末
	2018 年 4 月 20 日(基金最后运作日)
资产：	
银行存款	1,913,486.33
结算备付金	38,890.42

存出保证金	263.75
交易性金融资产	530,461.00
其中：股票投资	530,461.00
应收证券清算款	24,975,121.47
应收利息	5,435.18
其他资产	4,777.80
<b>资产总计</b>	<b>27,468,435.95</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负债：</b>	
应付赎回款	68,053.61
应付管理人报酬	552.12
应付托管费	110.42
应付交易费用	31,174.70
其他负债	125,120.32
<b>负债合计</b>	<b>225,011.17</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	19,387,521.81
未分配利润	7,855,902.97
<b>所有者权益合计</b>	<b>27,243,424.78</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>27,468,435.95</b>

注：报告截止日2018年4月20日(基金最后运作日)，基金份额净值为1.405元，基金份额总额为19,387,521.81份。

#### 四、清盘事项说明

##### 1、基本情况

景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[20]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）验证并出具验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于[2012]年[6]月[25]日正式生效，首次设立募集规模为人民币 244,522,615.24 元，折合 244,522,615.24 份基金份额。本基金为契约型开放式，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景顺长城基金管理有限公司，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：本基金以目标 ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，其中投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股（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，但需符合中国证监会的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会于[2018]年[4]月[19]日表决通过了《关于景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金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[4]月[23]日起进入清算期，清算期截止至[2018]年[5]月[29]日当日，共 37 天。

## 2、清算原因

本基金基金份额持有人大会通过《关于终止景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。

## 3、清算起始日

根据[2018]年[4]月[19]日本基金基金份额持有人大会通过的议案及议案说明，本基金将于[2018]年[4]月[23]日起进入清算期，清算日截至[2018]年[5]月[29]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4月23日至2018年5月29日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

### （一）清算费用

按照《景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》“二十三、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）资产处置情况

（1）本基金最后运作日的银行存款余额为人民币1,913,486.33元，该款项由基金托管人负责保管；

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币 38,890.42 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司收取并保管，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基金的结算备付金进行调整，截至 2018 年 5 月 29 日清算截止日本基金结算备付金余额为零。

（3）本基金最后运作日存出保证金人民币 263.75 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司收取并保管，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基金的存出保证金进行调整，截至 2018 年 5 月 29 日清算截止日本基金存出保证金余额为人民币 23,929.56 元，该笔资金由基金管理人景顺长城基金管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，基金管理人垫付的资金待清算公司返还后再归还基金管理人。

（4）本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 530,461.00 元，均为截至最后运作日本基金持有的流通受限股票，待股票复牌时对其进行变现处置后，本基金基金管理人将其归还基金份额持有人。

1) 本基金最后运作日（2018 年 4 月 20 日）持有的全部停牌股票明细为：

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	估值价格（人民币元）	最后运作日估值金额（人民币元）
----	------	------	-------	------------	-----------------

1	600158	中体产业	15,200	11.49	174,648.00
2	600221	海航控股	51,300	2.85	146,205.00
3	600485	信威集团	19,700	10.64	209,608.00

2) 截至清算截止日 (2018 年 5 月 29 日), 本基金持有的上述股票均未复牌。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 24,975,121.47 元, 该项资金为本基金于基金最后运作日 (2018 年 4 月 20 日) 变现本基金目标基金投资 (上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金) 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, 该资金分别于 2018 年 4 月 23 日、4 月 24 日划回基金托管账户, 由基金托管人负责保管。

(6) 本基金最后运作日应收利息为人民币 5,435.18 元, 由应收银行存款利息人民币 5,402.40 元, 应收结算备付金利息人民币 29.75 元, 应收存出保证金利息人民币 3.03 元构成。根据中国人民银行的存款结息规则, 待该部分应收利息资产于指定结息日结息划回托管户后, 本基金基金管理人将其与变现后的流通受限股票资产一并归还基金份额持有人。

(7) 本基金最后运作日其他资产为人民币 4,777.80 元, 为本基金于基金最后运作日 (2018 年 4 月 20 日) 变现本基金目标基金投资 (上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金) 形成的应收款项。按照本基金目标基金的资金交收规则, 该资金分别于 2018 年 4 月 23 日、5 月 3 日划回基金托管账户, 由基金托管人负责保管。

### (三) 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 68,053.61 元, 该款项已于 2018 年 4 月 23 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 552.12 元, 该款项已于 2018 年 5 月 3 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 110.42 元, 该款项已于 2018 年 5 月 3 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 31,174.70 元, 该款项由本基金 2018 年 2 季度投资交易产生的应付券商佣金构成, 该款项已于 2018 年 5 月 10 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 125,120.32 元, 由应付赎回费、预提审计



费用和信息披露费分别构成。

1) 应付赎回费为人民币51.42元，该款项已于2018年4月23日支付；

2) 预提信息披露费合计为人民币60,000.00元，按照信息披露合同该款项已于2018年5月7日分别支付中国证券报人民币20,000.00元，上海证券报人民币20,000.00元，证券时报人民币20,000.00元；

3) 截止本金最后运作日，本基金预提审计费用为人民币65,068.90元，预提的2017年年度审计费人民币50,000.00元已于2018年5月10日按照审计业务约定书的约定支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)；另人民币15,068.90元为预提的本基金2018年清算审计费，根据审计业务约定书的约定，本基金2018年清算审计费为人民币25,000.00元，本基金于基金清算期间以约定金额为上限继续对差额部分进行计提，足额计提后于2018年5月28日支付该项费用给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

#### (四) 清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项 目	金 额
一、2018年4月20日(基金最后运作日)基金净资产	<b>27,243,424.78</b>
加：清算期间（2018年4月23日至2018年5月29日）收入	<b>19,346.60</b>
利息收入-银行存款利息收入（注1）	19,299.16
利息收入-备付金及保证金利息收入（注1）	47.44
加：利息（2018年4月21日至2018年4月22日）收入（注2）	<b>80.06</b>
减：清算期间（2018年4月23日至2018年5月29日）费用	<b>9,516.84</b>
预提费用（注3）	9,436.84
其他费用（注4）	80.00
减：预提（2018年4月21日至2018年4月22日）费用（注5）	<b>494.26</b>
二、2018年5月29日(清算截止日)基金净资产（注6）	<b>27,252,840.34</b>

注：1、利息收入为暂以当前适用的利率预估计提的2018年4月23日至2018年5月29日清算期间的银行存款，结算备付金及存出保证金利息。

2、因4月21日，22日为法定节假日，节假日期间的银行存款，结算备付金及存出保证金利息收入作为收入一并计入本基金净资产进行清算。

3、预提费用为2018年4月23日至2018年5月29日期间预提审计费人民币9,436.84元。

4、其他费用为清算期间的银行划款手续费人民币 80.00 元。

5、因 4 月 21 日，22 日为法定节假日，节假日期间预提审计费人民币 494.26 元作为费用支出一并计入本基金净资产进行清算。

6、截止 2018 年 5 月 29 日本基金的净资产情况详见（五）

（五）截至 2018 年 5 月 29 日本基金的净资产情况如截止当日的资产负债表所示：

会计主体：景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2018 年 5 月 29 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 5 月 29 日(基金清算截止日)
<b>资 产：</b>	
银行存款	26,673,587.94
存出保证金	23,929.56
交易性金融资产	530,461.00
其中：股票投资	530,461.00
应收利息	24,861.84
<b>资产合计：</b>	<b>27,252,840.34</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负债：</b>	
<b>负债合计</b>	<b>0.00</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	19,387,521.81
未分配利润	7,865,318.53
<b>所有者权益合计</b>	<b>27,252,840.34</b>
<b>负债与持有人权益总计：</b>	<b>27,252,840.34</b>

资产处置及负债清偿后，2018年5月29日本基金剩余财产为人民币27,252,840.34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。

(六) 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) 景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金资产负债表及审计报告；

(2) 《景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告》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。

景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金财产清算小组

[2018]年[5]月[29]日